Relatório de Enquadramentos Legais da Carteira de Investimentos da EMBRAER PREV

Relatório de Política de Investimento - EMBRAER PREV

Referência: 30/09/2019

Renda Fixa	**2.303.231.513,27**
Renda Variável	**767.822.517,83**
Estruturado	**-**
Exterior	**-**
Imóveis	**127.881.453,37**
Empréstimos e Financiamentos	**35.736.797,25**
Contas Receber e Pagar	**(2.903.155,23)**
Derivativos	**178.831,72**
Patrimônio Líquido da Fundação	**3.231.947.958,21**

Segmento	Aplicação	% PL da Fundação	% Mínimo	% Máximo	Status
Renda Fixa	2.303.231.513,27	71,26%	35,00%	100,00%	Enquadrado
Renda Variável	767.822.517,83	23,76%	0,00%	50,00%	Enquadrado
Estruturado	-	0,00%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Exterior	-	0,00%	0,00%	10,00%	Enquadrado
Imobiliário	127.881.453,37	3,96%	0,00%	20,00%	Enquadrado
Operações com Participantes	35.736.797,25	1,11%	0,00%	15,00%	Enquadrado
Contas Receber e Pagar	(2.903.155,23)	-0,09%	N/A	N/A	N/A
Derivativos	178.831,72	0,01%	N/A	N/A	N/A

Relatório de Enquadramento dos Investimentos - EMBRAER PREV

Referencia	30/09/2019
Patrimônio Líquido .....:	3.231.947.958,21

Renda Fixa	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Renda Fixa - Títulos Públicos - Federais				
LFT	261.673.276,56	8,10%		
LTN	160.021.235,40	4,95%		
NTN_B	1.326.114.290,71	41,03%		
Total ..... :	1.747.808.802,67	54,08%	100,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Públicos	1.747.808.802,67	54,08%	100,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Instituição Financeira / Poupança				
CDB	7.221.252,42	0,22%		
LF252	139.362.862,40	4,31%		
Total ..... :	146.584.114,82			
Renda Fixa - FIDC / FIC				
Cotas FIDC	28.319.238,49	0,88%		
Total ..... :	28.319.238,49	0,88%	20,00%	Enquadrado
Renda Fixa - Títulos Privados - TVM de Companhias Abertas / Securitizadoras				
Debentures	380.519.357,29	11,77%		
Total ..... :	380.519.357,29			
Renda Fixa - Títulos Privados	555.422.710,60	17,19%	80,00%	Enquadrado
Renda Fixa	2.303.231.513,27	71,26%	100,00%	Enquadrado

Renda Variável	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
AÇÕES DE MERCADO				
Ações / FI de Segmento Especial				
BOVESPA NIVEL 1	174.357.912,59	5,39%		
BOVESPA NIVEL 2	154.441.828,15	4,78%		

NOVO MERCADO	389.924.515,84	12,06%		
Total ..... :	718.724.256,58	22,24%	70,00%	Enquadrado

Ações / FI sem Segmento Especial				
OUTROS	49.098.261,25	1,52%		
Total ..... :	49.098.261,25	1,52%	50,00%	Enquadrado

Renda Variável	767.822.517,83	23,76%	70,00%	Enquadrado

Imobiliário	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Imobiliário				
Imobiliário - Aluguéis e Renda *	2.158.495,98	0,07%		
Imobiliário				
Imobiliário - FI / FIC Imobiliário	82.125.095,97	2,54%		
Imobiliário				
Imobiliário - CRI	43.597.861,42	1,35%		
Imobiliário	127.881.453,37	3,96%	20,00%	Enquadrado

Empréstimos e Financiamento	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Empréstimos e Fin. Imobiliários				
Empréstimos	35.736.797,25	1,11%		
Empréstimos e Financiamentos Imobiliários	35.736.797,25	1,11%	15,00%	Enquadrado

Derivativos	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Derivativos				
Futuros	2.959.274,17	0,09%		
Opções	178.831,72	0,01%		

Derivativos	**178.831,72**	**0,10%**	**100,00%**	**Enquadrado**

Receitas e Despesas	Valor Aplicado	Aplicado (%)	Limite 4.661 (%)	Enquadramento
Contas Receber / Pagar				
Contas Receber / Pagar	**-2.957.296,86**	**-0,09%**		
Caixa				
Caixa	**54.141,63**	**0,00%**		

Contas Receber e Pagar	**-2.903.155,23**	
Total Geral dos Ativos	**3.231.947.958,21**	**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	**3.231.947.958,21**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.303.231.513,27	3.231.947.958,21	71,26%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	1.747.808.802,67	3.231.947.958,21	54,08%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	555.422.710,60	2.585.558.405,10	17,19%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC´s	646.389.601,27	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	323.194.800,64	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	807.986.989,55	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	807.986.989,55	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	767.822.517,83	2.262.363.532,22	23,76%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	807.986.989,55	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	127.881.453,37	646.389.601,27	3,96%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	35.736.797,25	484.792.213,00	1,11%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	646.389.601,27	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	323.194.800,64	0,00%	Enquadrado

Relatório de Diversificação - Debêntures

Referencia 30/09/2019

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
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
CBAN11	CONCESSIONARIA ROTA DAS BANDEIRAS S/A	834,00	55.000	1,5164%	Enquadrado
CBAN21	CONCESSIONARIA ROTA DAS BANDEIRAS S/A	303,00	55.000	0,5509%	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	SONAE SIERRA BRASIL 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
VIVT15	TELEFONICA BRASIL S/A	522,00	200.000	0,2610%	Enquadrado

Relatório de Diversificação - FIDC's

Referencia 30/09/2019

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
CELG DISTRIBUICAO FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	OLIVEIRA TRUST	10.659.436,38	122.698.548,24	8,6875%	Enquadrado
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.280.631,99	547.636.033,10	0,2338%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.900.000,00	120.000.000,00	5,7500%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	9.479.170,12	350.431.427,76	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	10.659.436,38	3.231.947.958,21	0,3298%	Enquadrado
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	BEM DTVM	1.280.631,99	3.231.947.958,21	0,0396%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS - VERDECARD	OLIVEIRA TRUST	6.900.000,00	3.231.947.958,21	0,2135%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS SANEAMENTO GOIAS SA - INFRAESTRUTURA IV	OLIVEIRA TRUST	9.479.170,12	3.231.947.958,21	0,2933%	Enquadrado

Fundação	PL Total da Fundação - R$	Total Aplicado em FIDC R$	% PL da Fundação	Status
Fundação	3.231.947.958,21	28.319.238,49	0,8762%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição não Financeira

Referencia 30/09/2019

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.231.947.958,21
Total de Instituição não Financeira	424.117.218,71
% Pl da Fundação	13,12%

Papel	Aplicação Atual	% Aplicado	Status
CRI	43.597.861,42	1,35%	
HABITASEC SECURITIZADORA SA	33.056.167,66	1,02%	Enquadrado
RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	10.541.693,76	0,33%	Enquadrado
Debentures	380.519.357,29	11,77%	
AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES SA	11.048.713,84	0,34%	Enquadrado
AES TIETE ENERGIA SA	2.013.687,77	0,06%	Enquadrado
AMPLA ENERGIA SERVICOS SA	1.247.678,34	0,04%	Enquadrado
CACHOEIRA PAULISTA TRANSMISSORA ENERGIA SA	8.258.585,17	0,26%	Enquadrado
CCR SA	4.919.705,21	0,15%	Enquadrado
CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	13.454.789,32	0,42%	Enquadrado
CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	3.905.495,22	0,12%	Enquadrado
CIA GAS SAO PAULO COMGAS	39.130.448,83	1,21%	Enquadrado
CIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	4.881.905,44	0,15%	Enquadrado
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	12.390.102,13	0,38%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA JAGUARA	1.647.892,01	0,05%	Enquadrado
COMPANHIA ENERGETICA MIRANDA	974.479,71	0,03%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	25.798.664,73	0,80%	Enquadrado
COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	2.136.131,94	0,07%	Enquadrado
CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	20.032.086,83	0,62%	Enquadrado
CONCESSIONARIA RODOVIAS AYRTON SENNA CARVALHO PINTO SA ECOPIST	13.815.968,67	0,43%	Enquadrado
CONCESSIONARIA ROTA BANDEREIRAS SA	17.000.867,22	0,53%	Enquadrado
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	2.039.998,74	0,06%	Enquadrado
DUKE ENERGY INTERNATIONAL GERACAO PARANAPANEMA SA	21.794.536,57	0,67%	Enquadrado

ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	12.949.397,81	0,40%	Enquadrado
ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A	799.277,96	0,02%	Enquadrado
ENTREVIAS CONCESSIONARIA RODOVIAS S.A	13.290.887,06	0,41%	Enquadrado
EQUATORIAL ENERGIA SA	689.547,34	0,02%	Enquadrado
ERDV	7.947.857,15	0,25%	Enquadrado
GRUPO CEMIG	18.664.405,63	0,58%	Enquadrado
GUARARAPES CONFECCOES SA (EX CONFECCOES GUARARAPES SA)	1.369.314,42	0,04%	Enquadrado
IGUATEMI EMPRESA SHOPPING CENTERS SA	7.805.267,23	0,24%	Enquadrado
JSL SA	794.408,76	0,02%	Enquadrado
LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	14.623.002,24	0,45%	Enquadrado
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.157.275,61	0,04%	Enquadrado
LOJAS AMERICANAS SA	22.516.301,52	0,70%	Enquadrado
MOVIDA PARTICIPACOES	1.201.256,31	0,04%	Enquadrado
NATURA COSMETICOS SA	1.758.998,20	0,05%	Enquadrado
NCF PARTICIPACOES SA	3.173.194,07	0,10%	Enquadrado
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	14.129.881,70	0,44%	Enquadrado
RAIZEN ENERGIA SA	1.337.099,14	0,04%	Enquadrado
RODOVIAS COLINAS SA	16.302.582,14	0,50%	Enquadrado
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.052.309,95	0,03%	Enquadrado
SONAE SIERRA BRASIL SA	1.076.457,88	0,03%	Enquadrado
SUL AMERICA SA	6.289.494,08	0,19%	Enquadrado
TELEFONICA BRASIL SA	5.280.526,56	0,16%	Enquadrado
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	19.040.905,89	0,59%	Enquadrado
TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	777.970,95	0,02%	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	**3.231.947.958,21**

Mercado	Cód. Bovespa	Valor Aplicado	% PL Fundação	Status
Ações Segmento Especial	NM, N2, N1, Mais, Mais2 ...	718.724.256,58	22,24%	Enquadrado
Ações s/ Segmento Especial		49.098.261,25	1,52%	Enquadrado
Total		**767.822.517,83**	**23,76%**	**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	3.231.947.958,21

Cód Ação	Empresa	Mercado	Valor Aplicado	% PL Fundação	Status	Quantidade de Ações na Carteira			% Capital Social		Status
						ON	PN	Total	ON	Total	
ABCB	BCO ABC BRASIL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	5.385.984,70	0,17%	Enquadrado	0	300.893	300.893	0,00%	0,00%	Enquadrado
ABEV	AMBEV S.A.	BOLSA	38.467.371,25	1,19%	Enquadrado	1.998.305	0	1.998.305	0,01%	0,01%	Enquadrado
AZUL	AZUL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	7.287.486,00	0,23%	Enquadrado	0	146.600	146.600	0,00%	0,00%	Enquadrado
B3SA	B3 S.A. - BRASIL, BOLSA, BALCÃO	NOVO MERCADO	38.527.166,09	1,19%	Enquadrado	883.043	0	883.043	0,04%	0,04%	Enquadrado
BBAS	BCO BRASIL S.A.	NOVO MERCADO	13.824.411,00	0,43%	Enquadrado	303.900	0	303.900	0,01%	0,01%	Enquadrado
BBDC	BCO BRADESCO S.A.	BOVESPA NIVEL 1	54.385.428,48	1,68%	Enquadrado	0	1.603.344	1.603.344	0,00%	0,00%	Enquadrado
BPAC	BCO BTG PACTUAL S.A.	BOVESPA NIVEL 2	17.453.755,00	0,54%	Enquadrado	298.100	596.200	894.300	0,00%	0,01%	Enquadrado
BRDT	PETROBRAS DISTRIBUIDORA S/A	NOVO MERCADO	11.892.960,00	0,37%	Enquadrado	432.000	0	432.000	0,04%	0,04%	Enquadrado
BRFS	BRF S.A.	NOVO MERCADO	18.981.580,00	0,59%	Enquadrado	496.900	0	496.900	0,06%	0,06%	Enquadrado
BTOW	B2W - COMPANHIA DIGITAL	NOVO MERCADO	28.267.102,25	0,87%	Enquadrado	584.635	0	584.635	0,13%	0,13%	Enquadrado
CCRO	CCR S.A.	NOVO MERCADO	21.817.800,00	0,68%	Enquadrado	1.264.800	0	1.264.800	0,06%	0,06%	Enquadrado
CESP	CESP - CIA ENERGETICA DE SAO PAULO	BOVESPA NIVEL 1	8.330.550,00	0,26%	Enquadrado	0	292.300	292.300	0,00%	0,00%	Enquadrado
CMIG	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	BOVESPA NIVEL 1	7.490.490,00	0,23%	Enquadrado	471.100	0	471.100	0,10%	0,03%	Enquadrado
CYRE	CYRELA BRAZIL REALTY S.A.EMPREEND E PART	NOVO MERCADO	8.059.155,00	0,25%	Enquadrado	335.100	0	335.100	0,08%	0,08%	Enquadrado
ENGI	ENERGISA S.A.	BOVESPA NIVEL 2	8.234.757,00	0,25%	Enquadrado	164.860	659.440	824.300	0,00%	0,01%	Enquadrado
EVEN	EVEN CONSTRUTORA E INCORPORADORA S.A.	NOVO MERCADO	5.666.850,00	0,18%	Enquadrado	539.700	0	539.700	0,25%	0,25%	Enquadrado
HAPV	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	NOVO MERCADO	24.658.184,25	0,76%	Enquadrado	457.905	0	457.905	0,06%	0,06%	Enquadrado
IRBR	IRB - BRASIL RESSEGUROS S.A.	NOVO MERCADO	13.467.216,00	0,42%	Enquadrado	357.600	0	357.600	0,04%	0,04%	Enquadrado
ITSA	ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU S.A.	BOVESPA NIVEL 1	7.850.008,00	0,24%	Enquadrado	0	595.600	595.600	0,00%	0,00%	Enquadrado
ITUB	ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	BOVESPA NIVEL 1	75.385.856,11	2,33%	Enquadrado	0	2.152.037	2.152.037	0,00%	0,00%	Enquadrado
JBSS	JBS S.A.	NOVO MERCADO	25.504.062,00	0,79%	Enquadrado	777.800	0	777.800	0,03%	0,03%	Enquadrado
KROT	KROTON EDUCACIONAL S.A.	NOVO MERCADO	16.746.522,00	0,52%	Enquadrado	1.497.900	0	1.497.900	0,09%	0,09%	Enquadrado
LREN	LOJAS RENNER S.A.	NOVO MERCADO	15.938.426,00	0,49%	Enquadrado	315.800	0	315.800	0,04%	0,04%	Enquadrado
NEOE	NEOENERGIA S.A.	NOVO MERCADO	12.669.063,00	0,39%	Enquadrado	615.900	0	615.900	0,05%	0,05%	Enquadrado
PCAR	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	BOVESPA NIVEL 1	20.915.580,00	0,65%	Enquadrado	0	262.100	262.100	0,00%	0,00%	Enquadrado
PETR	PETROLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS	BOVESPA NIVEL 2	101.210.125,45	3,13%	Enquadrado	538.600	3.084.259	3.622.859	0,01%	0,03%	Enquadrado
RAIL	RUMO S.A.	NOVO MERCADO	23.909.550,00	0,74%	Enquadrado	975.900	0	975.900	0,06%	0,06%	Enquadrado
RENT	LOCALIZA RENT A CAR S.A.	NOVO MERCADO	18.038.528,00	0,56%	Enquadrado	396.800	0	396.800	0,05%	0,05%	Enquadrado
SAPR	CIA SANEAMENTO DO PARANA - SANEPAR	BOVESPA NIVEL 2	14.869.720,00	0,46%	Enquadrado	176.600	706.400	883.000	0,00%	0,04%	Enquadrado
SMTO	SAO MARTINHO S.A.	NOVO MERCADO	2.076.920,00	0,06%	Enquadrado	109.600	0	109.600	0,03%	0,03%	Enquadrado
SUZB	SUZANO S.A.	NOVO MERCADO	17.471.080,00	0,54%	Enquadrado	519.200	0	519.200	0,04%	0,04%	Enquadrado
TOTS	TOTVS S.A.	NOVO MERCADO	24.949.454,00	0,77%	Enquadrado	432.100	0	432.100	0,22%	0,22%	Enquadrado
VALE	VALE S.A.	NOVO MERCADO	47.458.486,25	1,47%	Enquadrado	993.895	0	993.895	0,02%	0,02%	Enquadrado
VIVT	TELEFÔNICA BRASIL S.A	BOLSA	10.630.890,00	0,33%	Enquadrado	0	193.500	193.500	0,00%	0,00%	Enquadrado

Relatório de Diversificação de Renda Fixa - Instituição Financeira

Referencia 30/09/2019

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.231.947.958,21

Papel	Aplicação Atual	PL da Instituição	% Instituição	Status	% Fundação	Status
BANCO ABC BRASIL S/A						
LF252	1.770.124,49					
Total	**1.770.124,49**	**3.882.217.000,00**	**0,05%**	**Enquadrado**	**0,05%**	**Enquadrado**
BANCO ALFA DE INVESTIMENTOS S/A						
LF252	2.035.355,07					
Total	**2.035.355,07**	**1.463.448.000,00**	**0,14%**	**Enquadrado**	**0,06%**	**Enquadrado**
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A						
LF252	3.485.948,18					
Total	**3.485.948,18**	**2.785.984.000,00**	**0,13%**	**Enquadrado**	**0,11%**	**Enquadrado**
BANCO BRADESCO S.A						
LF252	44.125.547,72					
Total	**44.125.547,72**	**134.639.066.000,00**	**0,03%**	**Enquadrado**	**1,37%**	**Enquadrado**
BANCO VOTORANTIM						
LF252	37.230.621,35					
Total	**37.230.621,35**	**9.745.035.000,00**	**0,38%**	**Enquadrado**	**1,15%**	**Enquadrado**
BCO BRASIL SA						
LF252	9.861.864,77					
Total	**9.861.864,77**	**91.685.951.000,00**	**0,01%**	**Enquadrado**	**0,31%**	**Enquadrado**
BCO ITAU SA						
LF252	37.369.342,74					
Total	**37.369.342,74**	**138.288.053.000,00**	**0,03%**	**Enquadrado**	**0,24%**	**Enquadrado**
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA						
CDB	5.178.359,12					
Total	**5.178.359,12**	**1.798.269.000,00**	**0,29%**	**Enquadrado**	**0,16%**	**Enquadrado**
BCO VOLKSWAGEN SA						
CDB	2.042.893,30					
Total	**2.042.893,30**	**2.832.275.000,00**	**0,07%**	**Enquadrado**	**0,06%**	**Enquadrado**

CAIXA ECONOMICA FEDERAL						
LF252	1.800.428,30					
Total	**1.800.428,30**	**47.840.707.000,00**	**0,00%**	**Enquadrado**	**0,06%**	**Enquadrado**

PORTOSEG S.A CREDITO FINANCIAMENTO						
LF252	1.683.629,78					
Total	**1.683.629,78**	**788.880.000,00**	**0,21%**	**Enquadrado**	**0,05%**	**Enquadrado**

Relatório de Diversificação de Fundos de Investimentos

Referencia 30/09/2019

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		1.913.512,00	111.636.718,33	1,7141%	Enquadrado
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.583.827,00	116.787.709,13	3,0687%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		3.043.537,64	156.445.723,02	1,9454%	Enquadrado
FLORIPA SHOPPING FUNDO INVEST IMOBILIARIO		141.550,00	79.535.375,49	0,1780%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		4.333.421,70	775.828.930,18	0,5586%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		1.893.929,10	93.269.242,21	2,0306%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		1.618.168,10	272.928.039,80	0,5929%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		1.412.752,16	160.063.261,83	0,8826%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		2.901.580,30	250.468.761,05	1,1585%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		2.372.820,00	105.168.656,30	2,2562%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		4.820.643,52	373.176.947,11	1,2918%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		601.955,20	373.176.947,11	0,1613%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		2.020.948,16	373.176.947,11	0,5416%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		844.369,60	250.952.614,66	0,3365%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		3.792.067,68	525.663.617,23	0,7214%	Enquadrado
FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL		2.880.416,16	208.943.272,73	1,3786%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		3.388.262,40	646.913.701,78	0,5238%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		52.745,00	288.997.317,39	0,0183%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		5.196.542,89	288.997.317,39	1,7981%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		4.747.050,00	288.997.317,39	1,6426%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		2.596.860,00	100.120.313,41	2,5937%	Enquadrado
RENDA ESCRITORIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		1.555.896,36	64.694.384,20	2,4050%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.062.897,84	442.268.253,03	0,2403%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO		3.000.000,00	347.788.215,01	0,8626%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.627.090,50	183.879.218,94	1,9725%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII		3.440.305,30	1.070.031.077,91	0,3215%	Enquadrado
XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO		3.019.751,46	247.264.489,38	1,2213%	Enquadrado
XP LOG FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII		1.051.307,00	664.230.481,90	0,1583%	Enquadrado
XP LOG FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII		5.041.596,40	664.230.481,90	0,7590%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS		2.310.292,50	1.409.594.774,96	0,1639%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS		3.859.000,00	1.409.594.774,96	0,2738%	Enquadrado

Fundo	Administrador	Valor Aplicado R$	PL da Fundação R$	% PL da Fundação	Status
CASTELLO BRANCO OFFICE PARK FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		1.913.512,00	3.231.947.958,21	0,0592%	Enquadrado
CSHG GR LOUVEIRA FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII		3.583.827,00	3.231.947.958,21	0,1109%	Enquadrado
FII BB VOTORANTIM CIDADE JARDIM CONTINENTAL TOWER		3.043.537,64	3.231.947.958,21	0,0942%	Enquadrado
FLORIPA SHOPPING FUNDO INVEST IMOBILIARIO		141.550,00	3.231.947.958,21	0,0044%	Enquadrado
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - VBI LOGÍSTICO		4.333.421,70	3.231.947.958,21	0,1341%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM BRASCAN LAJES CORPORATIVAS FII		1.893.929,10	3.231.947.958,21	0,0586%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO BM CENESP FII		1.618.168,10	3.231.947.958,21	0,0501%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII CEO CYRELA COMMERCIAL PROPERTIES		1.412.752,16	3.231.947.958,21	0,0437%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO GENERAL SHOPPING ATIVO RENDA FII		2.901.580,30	3.231.947.958,21	0,0898%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO MAX RETAIL		2.372.820,00	3.231.947.958,21	0,0734%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA		7.443.546,88	3.231.947.958,21	0,2303%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO RIO NEGRO FII		844.369,60	3.231.947.958,21	0,0261%	Enquadrado
FUNDO INVEST IMOBILIARIO VIA PARQUE SHOPPING		3.792.067,68	3.231.947.958,21	0,1173%	Enquadrado

FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII SHOPPING JARDIM SUL	2.880.416,16	3.231.947.958,21	0,0891%	Enquadrado
HSI MALLS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	3.388.262,40	3.231.947.958,21	0,1048%	Enquadrado
MALLS BRASIL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	9.996.337,89	3.231.947.958,21	0,3093%	Enquadrado
RB CAPITAL GENERAL SHOPPING SULACAP FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	2.596.860,00	3.231.947.958,21	0,0803%	Enquadrado
RENDA ESCRITORIOS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	1.555.896,36	3.231.947.958,21	0,0481%	Enquadrado
SDI LOGISTICA RIO FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	1.062.897,84	3.231.947.958,21	0,0329%	Enquadrado
SDI PROPERTIES FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	3.000.000,00	3.231.947.958,21	0,0928%	Enquadrado
TRX REALTY LOGISTICA RENDA I FUNDO INVEST IMOBILIARIO FII	3.627.090,50	3.231.947.958,21	0,1122%	Enquadrado
VINCI SHOPPING CENTERS FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII	3.440.305,30	3.231.947.958,21	0,1064%	Enquadrado
XP INDUSTRIAL FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO	3.019.751,46	3.231.947.958,21	0,0934%	Enquadrado
XP LOG FUNDO INVESTIMENTO IMOBILIARIO FII	6.092.903,40	3.231.947.958,21	0,1885%	Enquadrado
XP MALLS FUNDO INVESTIMENTOS IMOBILIARIOS	6.169.292,50	3.231.947.958,21	0,1909%	Enquadrado

Relatório de Alocação por Grupo Econômico

Referencia 30/09/2019

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

Patrimônio Líquido da Fundação	3.231.947.958,21

Grupo Econômico	Aplicação Atual	% Fundação	Status
Grupo Banco do Brasil			
LF252 - BANCO DO BRASIL S.A.	9.861.864,77		
LF252 - BANCO VOTORANTIM	37.230.621,35		
Ações - BANCO DO BRASIL S.A.	13.824.411,00		
Total	**60.916.897,12**	**1,88%**	**Enquadrado**
Grupo BNP Paribas Brasil			
LF252 - BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A	3.485.948,18		
Total	**3.485.948,18**	**0,11%**	**Enquadrado**
Grupo BR Foods			
Ações - BRF BRASIL FOODS SA	18.981.580,00		
Total	**18.981.580,00**	**0,59%**	**Enquadrado**
Grupo Bradesco			
LF252 - BANCO BRADESCO S.A	44.125.547,72		
Ações - BANCO BRADESCO S.A	54.385.428,48		
Total	**98.510.976,20**	**3,05%**	**Enquadrado**
Grupo BTG Pactual			
Ações - BANCO BTG PACTUAL	17.453.755,00		
Total	**17.453.755,00**	**0,54%**	**Enquadrado**
Grupo Cemig			
Debentures - CEMIG GERAÇÃO E TRANSMISSÃO SA	13.454.789,32		
Debentures - GRUPO CEMIG	18.664.405,63		
Ações - GRUPO CEMIG	7.490.490,00		
Total	**39.609.684,95**	**1,23%**	**Enquadrado**
Grupo Itaú			
LF252 - BANCO ITAÚ S.A.	29.759.879,11		
Ações - BANCO ITAÚ S.A.	83.235.864,11		
Total	**112.995.743,22**	**3,50%**	**Enquadrado**
Grupo Vale do Rio Doce			
Ações - VALE SA	47.458.486,25		
Total	**47.458.486,25**	**1,47%**	**Enquadrado**