

# Relatório Mensal | Demonstrativo de Investimentos

Data de referência: 30/09/2020



## Plano: FUNBEP I

### Alocação por Segmento

| Carteira Própria              |                         |              |
|-------------------------------|-------------------------|--------------|
| Segmento                      | Valor (R\$)             | % (PL Total) |
| Renda Fixa                    | 751.762.624,38          | 15,1%        |
| Renda Variável                | 18.282,84               | 0,0%         |
| Empréstimos à Partic.         | 37.300.135,76           | 0,8%         |
| Imóveis                       | 139.232.803,84          | 2,8%         |
| Contrato de Swap              | 235.985.264,14          | 4,7%         |
| Valores a Pagar / Receber     | 1.262.004,34            | 0,0%         |
| <b>Total Carteira Própria</b> | <b>1.165.561.115,30</b> | <b>23,4%</b> |

| Fundos de Investimentos              |                         |              |
|--------------------------------------|-------------------------|--------------|
| Segmento                             | Valor (R\$)             | % (PL Total) |
| Renda Fixa                           | 3.663.697.051,32        | 73,7%        |
| Renda Variável                       | 143.320.730,66          | 2,9%         |
| Valores a Pagar / Receber -          | 53.376,01               | 0,0%         |
| Tesouraria                           | 52.672,95               | 0,0%         |
| <b>Total Fundos de Investimentos</b> | <b>3.807.017.078,92</b> | <b>76,6%</b> |

### Detalhamento dos Investimentos

#### Alocação Carteira Própria **1.165.561.115,30** **23,4%**

| Renda Fixa                  |                           |            | 751.762.624,38 | 15,1%        |
|-----------------------------|---------------------------|------------|----------------|--------------|
| Ativo                       | Vencimento                | Quantidade | Valor (R\$)    | % (PL Total) |
| Depósitos                   | -                         | -          | 2.950.399,70   | 0,1%         |
| NTN-B                       | 15/08/2050                | 20.000     | 62.773.705,58  | 1,3%         |
| NTN-C                       | 01/01/2031                | 100.090    | 686.038.519,10 | 13,8%        |
| Renda Variável              |                           |            | 18.282,84      | 0,0%         |
| MTSP4                       | METRO SP PN               | 15.342     | 153,42         | 0,0%         |
| INGA4                       | STEVIAFARMA IND PN *      | 145.100    | 4,34           | 0,0%         |
| FIVI4                       | FIVES LILLE PN *          | 8.450      | 0,08           | 0,0%         |
| EFOE3                       | ESTRADA DE FERRO PARANA ( | 3.125.000  | 18.125,00      | 0,0%         |
| Imóveis                     |                           |            | 139.232.803,84 | 2,8%         |
| Empréstimos à Participantes |                           |            | 37.300.135,76  | 0,8%         |
| Derivativos                 |                           |            | 235.985.264,14 | 4,7%         |
| Contrato de Swap            |                           |            |                |              |
| Valores a Pagar / Receber   |                           |            | 1.262.004,34   | 0,0%         |

#### Alocação Em Fundos de Investimentos (1º Nível) **3.807.017.078,92** **76,6%**

| Fundo                | Segmento       | Quantidade  | Valor (R\$)      | % (PL Total) |
|----------------------|----------------|-------------|------------------|--------------|
| AJ II TIT PUBLICO FI | Renda Fixa     | 399.593     | 4.241.500,62     | 0,1%         |
| AJ TIT PÚBLICOS      | Renda Fixa     | 2.885.299   | 12.484.243,81    | 0,3%         |
| RT REPUBLIC FI       | Renda Fixa     | 1.991.600   | 51.135.329,60    | 1,0%         |
| RT VICTORY LDI RF FI | Renda Fixa     | 127.892.128 | 3.595.834.900,04 | 72,3%        |
| CONSTELLATION FIA    | Renda Variável | 6.882.970   | 143.321.104,85   | 2,9%         |

**Composição da alocação em Fundos de Investimentos****3.807.017.078,92****76,6%**

| <b>Renda Fixa</b>             |                    |                   | <b>3.663.697.051,32</b> | <b>73,7%</b>        |
|-------------------------------|--------------------|-------------------|-------------------------|---------------------|
| <b>Ativo</b>                  | <b>Vencimento</b>  | <b>Quantidade</b> | <b>Valor (R\$)</b>      | <b>% (PL Total)</b> |
| NTN-B                         | 15/08/2050         | 110.350           | 358.850.499,55          | 7,2%                |
| NTN-B                         | 15/05/2055         | 69.630            | 233.846.068,36          | 4,7%                |
| NTN-C                         | 01/04/2021         | 5.000             | 25.286.963,74           | 0,5%                |
| NTN-C                         | 01/01/2031         | 360.132           | 2.498.791.383,92        | 50,3%               |
| COMPROMISSADA                 | -                  | 16.095            | 49.880.845,46           | 1,0%                |
| LFS                           | -                  | 667               | 478.486.430,35          | 9,6%                |
| LFT                           | -                  | 171               | 1.829.115,50            | 0,0%                |
| AJ II TIT PUBLICO FI          | 32.223.781/0001-70 | 399.593           | 4.241.500,62            | 0,1%                |
| AJ TIT PÚBLICOS               | 07.179.624/0001-67 | 2.885.299         | 12.484.243,81           | 0,3%                |
| <b>Renda Variável</b>         |                    |                   | <b>143.320.730,66</b>   | <b>2,9%</b>         |
| DUNAMIS                       | 25.306.605/0001-36 | 352.819           | 6.995.306,36            | 0,1%                |
| SINGULARITY AÇÕES             | 13.945.105/0001-65 | 19.214.443        | 64.003.253,60           | 1,3%                |
| IT INST A PHOENIX             | 23.731.629/0001-07 | 171.312           | 3.338.747,97            | 0,1%                |
| INDEX IBOVESPA ACOES          | 03.370.003/0001-05 | 163.882           | 16.036.890,85           | 0,3%                |
| EQUINOX AÇÕES                 | 14.097.532/0001-01 | 2.870.297         | 52.946.531,89           | 1,1%                |
| <b>Contas à Pagar/Receber</b> |                    |                   | <b>-53.376,01</b>       | <b>0,0%</b>         |
| <b>Tesouraria</b>             |                    |                   | <b>52.672,95</b>        | <b>0,0%</b>         |