

Boletim de

DESEMPENHO

Plano 1 - Ago / 2020



-



=



Balço Patrimonial

Ativo

Onde estão aplicados todos os recursos do Plano 1



Estes são distribuídos em uma Carteira de Investimentos

Passivo



Reservas matemáticas para fazer frente aos compromissos atuais e futuros dos pagamentos de benefícios

Meta Atuarial:

INPC + 4,75% a.a.

Distribuição da Carteira de Investimentos - Ago / 2020

Renda Variável



Investimentos em ações

43,57% Carteira Mercado
46,79% Carteira Participações

8,55% Carteira Índices
1,10% Carteira Terceirizada



43,54%

Renda Fixa



Regras de remuneração definidas

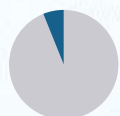


46,71%

Investimentos Imobiliários



Comprar, vender e alugar imóveis comerciais, galpões logísticos e shopping centers



6,10%

Operações com Participantes



Financiamento Imobiliário e Empréstimos Simples

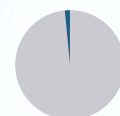


2,96%

Investimentos Estruturados



Investir em empresas com potencial de crescimento e vender a participação anos depois



0,52%

Investimentos no Exterior



Aplicar em ativos no exterior para obtenção de rentabilidade



0,16%

Balanço Patrimonial

Ativo

Onde estão aplicados todos os recursos do Plano 1



Estes são distribuídos em uma Carteira de Investimentos

Passivo



Distribuição da Carteira de Investimentos - Ago / 2020

Rentabilidade 2020: - 0,24% Valor de Mercado (mil) Ago / 2020: 183.535.666 ●

Reservas matemáticas para fazer frente aos compromissos atuais e futuros dos pagamentos de benefícios

Meta Atuarial acumulada em 2020:
4,34%

Renda Variável



Rentabilidade 2020
- 4,30%

Valor Ago-2020 (mil)
79.920.530



Renda Fixa



Rentabilidade 2020
4,18%

Valor Ago-2020 (mil)
85.731.034



Investimentos Imobiliários



Rentabilidade 2020
8,29%

Valor Ago-2020 (mil)
11.201.574



Operações com Participantes



Rentabilidade 2020
5,86%

Valor Ago-2020 (mil)
5.432.079



Investimentos Estruturados



Rentabilidade 2020
2,27%

Valor Ago-2020 (mil)
959.740



Investimentos no Exterior



Rentabilidade 2020
35,60%

Valor Ago-2020 (mil)
290.709



● Abaixo da Meta Atuarial

● Acima da Meta Atuarial



Rentabilidade Acumulada

Meta Atuarial
acumulada:
4,34%

	Valor (R\$ Mil)	Participação (%)	Rentabilidade de Agosto %	Rentabilidade Acumulada em 2020
Plano 1	183.535.666	100%	0,48%	- 0,24%
Renda Fixa	85.731.034	46,71%	0,39%	4,18%
Renda Variável	79.920.530	43,54%	0,46%	- 4,30%
Carteira Mercado	34.819.508	43,57%	- 3,43%	- 14,70%
Carteira Participações	37.392.650	46,79%	5,06%	7,80%
Carteira Índices	6.830.232	8,55%	- 2,85%	- 12,96%
Carteira Terceirizada	878.140	1,10%	- 1,35%	- 16,51%
Investimentos Estruturados	959.740	0,52%	- 0,08%	2,27%
Investimentos Exterior	290.709	0,16%	9,67%	35,60%
Investimentos Imobiliários	11.201.574	6,10%	0,78%	8,29%
Operações com Participantes	5.432.079	2,96%	0,56%	5,86%
Superávit/Déficit (R\$ Milhões)			- 591	- 7,813
Resultado Acumulado (R\$ Milhões)				- 5,437



Renda Variável

[confira a relação completa dos ativos da carteira](#)

Valor de Mercado
(R\$ milhões)



43,54%

12 Maiores Ativos	Ago / 2020	% na carteira	% patrimônio total
Litela Participações S.A.	25.491,77	31,90%	13,89%
Vale S.A.	14.928,76	18,68%	8,13%
Neoenergia S.A.	6.852,95	8,57%	3,73%
Banco do Brasil S.A.	4.308,39	5,39%	2,35%
Petrobras	3.911,46	4,89%	2,13%
Litel Participações S.A.	3.439,14	4,30%	1,87%
Itau Unibanco Holding S.A.	2.599,39	3,25%	1,42%
Ambev S.A.	2.452,09	3,07%	1,34%
Banco Bradesco S.A.	1.646,46	2,06%	0,90%
BRF S.A.	1.451,25	1,82%	0,79%
Itausa Investimentos Itau S.A.	1.196,79	1,50%	0,65%
Magazine Luiza S.A.	1.059,88	1,33%	0,58%

Valor total da carteira
(R\$ milhões)

79.920,53

Valor dos 12 maiores ativos
(representa 87% da carteira)

69.338,34



Renda Variável

[confira a relação completa dos ativos da carteira](#)

Resultado Financeiro (R\$ milhões)

OBS: O resultado financeiro considera a valorização/desvalorização do ativo apurado no período e o direito ao recebimento de dividendos e JCP eventualmente ocorridos.

Variação principais ativos	2018	2019	2020
LITELA PARTICIPAÇÕES S.A.	-	28.344	4.917
NEOENERGIA S.A.	554	2.077	-2.142
BANCO DO BRASIL S.A.	3.518	1.421	-2.504
PETROBRAS	2.498	956	-1.464
AMBEV S.A.	-1.270	901	-1.264
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	1.199	210	-1.363
BANCO BRADESCO S.A.	483	518	-989
LITEL PARTICIPAÇÕES S.A.	15.051	-33.306	596
BRF S.A.	-1.243	1.160	-1.127
ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU S.A.	519	124	-534
ULTRAPAR PARTICIPAÇÕES S.A.	-453	-25	-252
INVEPAR	-555	0	0
Variação Anual (R\$ milhões)	↑ 20.301	↑ 1.435	↓ - 6.129



Renda Fixa

confira a relação completa dos ativos da carteira



46,71%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação na carteira	Rentabilidade	
			Ago / 2020	Acumulado 2020
Renda Fixa	85.731.034	46,71%	0,39%	4,18%
Títulos públicos mantidos até o vencimento títulos públicos emitidos pelo Tesouro Nacional que têm seu valor nominal atualizado diariamente, pela sua taxa de juros. Ex: NTN-B	45.615.809	53,21%	0,74%	5,06%
Títulos públicos para negociação títulos públicos emitidos pelo Tesouro Nacional precificados pelo valor de mercado em uma determinada data. Esse preço de mercado é apurado diariamente com base nas negociações de compra/venda dos diversos agentes no mercado secundário.	20.446.435	23,85%	-1,53%	0,95%
Caixa operações compromissadas, com liquidez diária, remuneradas a 100% da taxa Selic.	14.276.226	16,65%	0,16%	2,12%
Títulos privados de instituições financeiras títulos de renda fixa emitidos pelos bancos, como CDB e Letras Financeiras, que possuem prazo de vencimento superior a 2 anos.	2.253.848	2,63%	0,58%	4,46%
Títulos privados de instit. não financeiras títulos de renda fixa emitidos por empresas que não são bancos, notadamente as debêntures e notas promissórias.	2.957.858	3,45%	8,87%	14,88%
Fundos de Investimentos RF	180.858	0,21%	1,18%	6,36%



Renda Fixa

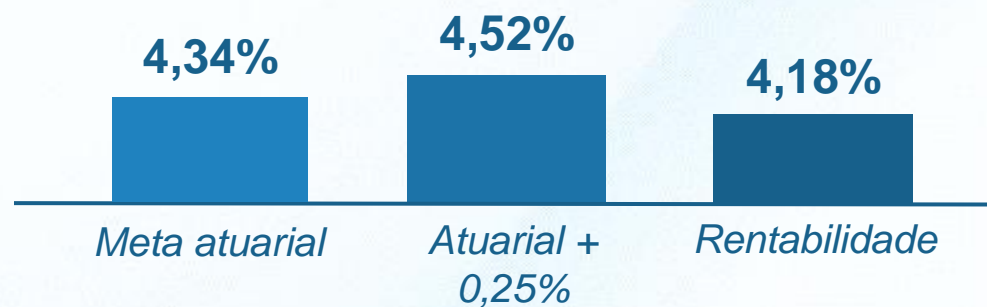
[confira a relação completa dos ativos da carteira](#)



46,71%

Eficiência Comparada

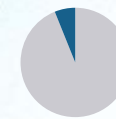
Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos Imobiliários

[confira a relação completa dos ativos da carteira](#)



6,10%

Valor de Mercado (R\$ Mil)

11.201.574

Rentabilidade

Ago / 2020

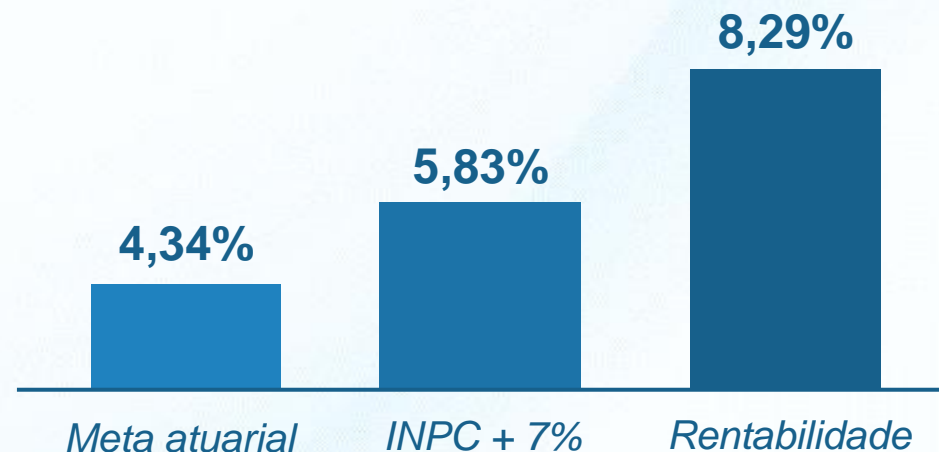
0,78%

Acumulado 2020

8,29%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Operações com Participantes



2,96%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade	
			Ago / 2020	Acum. 2020
Empréstimos e Financiamentos	5.432.079	2,96%	0,56%	5,86%
Empréstimos	4.696.584	86,46%	0,40%	5,46%
Financiamentos	735.496	13,54%	1,56%	7,94%



Investimentos Estruturados

[confira a relação completa dos ativos da carteira](#)

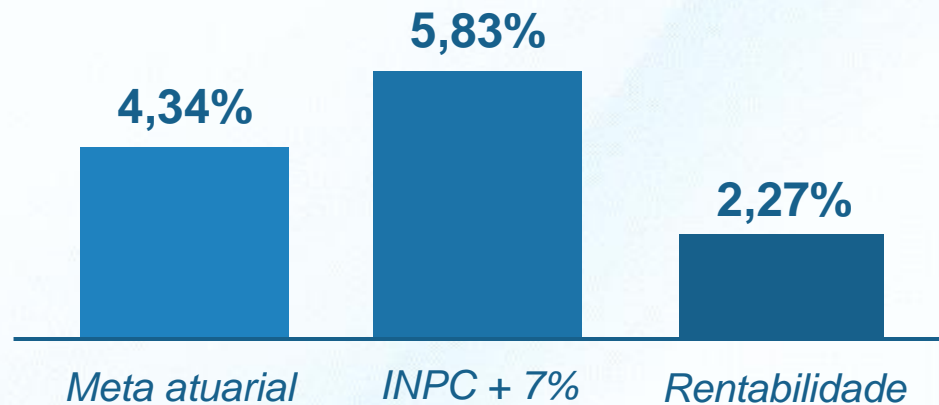


0,52%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade	
			Ago / 2020	Acum. 2020
Investimentos Estruturados	959.740	0,52%	- 0,08%	2,27%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





Investimentos no Exterior

[confira a relação completa dos ativos da carteira](#)

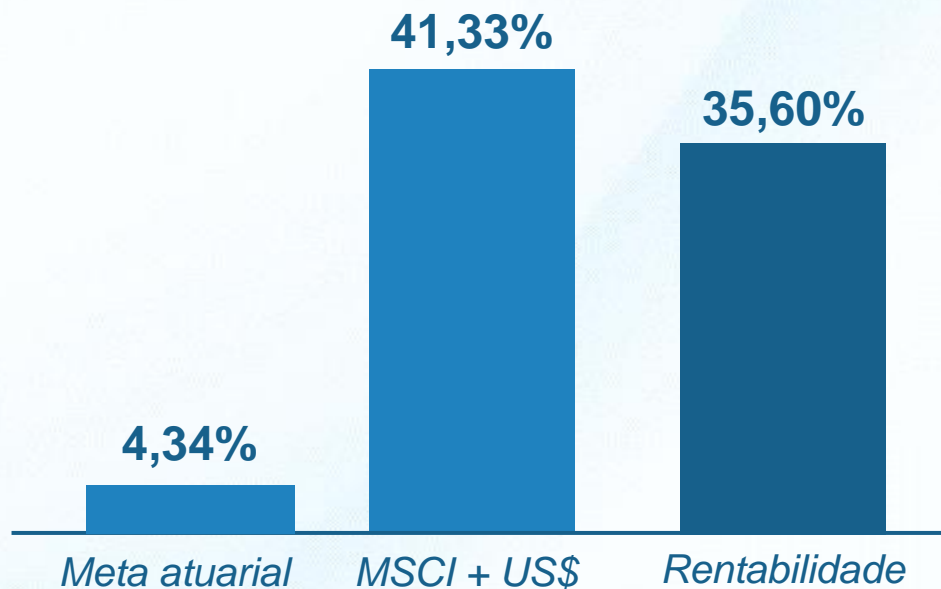


0,16%

Carteiras	Valor de Mercado (R\$ Mil)	Participação	Rentabilidade	
			Ago / 2020	Acum. 2020
Investimentos no Exterior	290.709	0,16%	9,67%	35,60%

Eficiência Comparada

Meta Atuarial x Benchmark x Rentabilidade





[Fale Conosco](#)



0800 729 0505



[Canal Web](#)

OUVIR
SUA VOZ.

0800 729 0303