

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 30/04/2020

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Resgate	Resgate	VLR. APLICADO		Rentabilidade					SEGMENTO / CATEGORIA	Limites					NORMA
				Nominal	% Patr do RPPS	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	% Benchmark ano		PL do Fundo	% s/PL do Fundo	Aplicado RPPS	RESOL 3.922 + Nivel 1 Pró Gestão	Politic Invest	
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																	
				49.927.567,18	10,95%							65,29%					
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 2.000			7.506.372,92	1,65%	0,00%					IPCA + 6,35 % aa	1,6444					
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400			13.054.446,01	2,86%	0,00%					IPCA + 6,248 % aa						
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000			16.314.860,14	3,58%	0,00%					IPCA + 5,688 % aa						
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200			13.051.888,11	2,86%	0,00%					IPCA + 7,484 % aa						
				196.300.761,72	43,06%												
Santander FFPREV	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ. - 13.455.117/0001/01	D+0	D+1	42.897.208,21	9,41%	0,49%					do IMA-B	1.142.331.144	3,76%				
Santander FFPREV	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D+0	D+1	12.400.797,38	2,72%	1,04%					do IMA-B	2.883.334.112	0,43%				
Santander FFPREV	FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D+0	D+1	22.989.769,86	5,04%	1,26%					do IMA-B	1.212.263.387	1,90%				
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D+0	D+1	11.935.611,25	2,62%	1,07%					do IRF-M	4.883.028.533	0,24%				
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D+0	D+1	5.829.227,60	1,28%	0,49%					do IMA-B5	4.608.504.107	0,13%				
CEF FFPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D+0	D+0	41.635.332,98	9,13%	1,13%					do IMA-B5	16.130.391.856	0,26%				
CEF FFPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10	D+0	D+0	38.982.112,60	8,55%	0,47%					do IMA-B5	9.104.032.681	0,43%				
Sul América - FFPREV	INFLATIE FI RF LP 09.326.708/0001-01	D+1	D+2	13.693.135,88	3,00%	1,14%					do IMA-B	1.309.910.976	1,05%				
Western Asset FFPREV	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D+0	D+1	5.937.565,96	1,30%	0,90%					do IMA-B5	572.988.052	1,04%				
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C																	
Operações Compromissadas Lastreadas 100%em TP do TN - Art. 7º, Inciso II																	
				13.650.608,92	2,99%												
CEF FFPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D+0	D+0	13.650.608,92	2,99%	1,25%				3,58%	do IMA-B	2.806.802.535	0,49%				
Fundos de Índice ETF Renda Fixa em Indicadores de Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso III, Alínea B																	
				37.809.567,57	8,29%												
Fundos de Renda Fixa Geral - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "A"																	
Santander FFPREV-491-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D+0	D+0	62.253,27	0,01%	0,06%					do CDI	2.829.946.609	0,00%				
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	D+0	D+1	2.472.203,13	0,54%	1,36%					do IMA-B	1.856.360.050	0,13%				
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D+0	D+1	12.102.849,71	2,65%	0,55%					do IMA-B5	887.003.090	1,36%				
AZQUEST	Yield FIORF LP CNPJ 16.599.968/0001-16	D+0	D+1	6.616.695,57	1,45%	0,25%					do CDI	227.865.021	2,90%				
ITAÚ FFPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D+0	D+1	10.179.360,60	2,23%	0,14%					IPCA	5.079.848.329	0,20%				
ICATU FFPREV	Icatu Vang Infl Curta FI RF 10.922.432/0001-03	D+0	D+1	6.376.205,29	1,40%	0,48%					do IMA-B5	550.543.002	1,16%				
Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Quaisquer Indicadores - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"																	
Letras Imobiliárias Garantida - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"																	
Certificados de Depósitos Bancários - CDB (limitado ao FGC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"																	
Poupança (limitado ao FGC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B"																	
FIDC Cotas Sênior - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A"																	
Fundos Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B"																	
Fundos de Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C"																	
INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS																	
23,67%																	
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"																	
					0,00%												
Fundos ETF Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"																	
					0,00%												
				85.307.835,86	18,71%												
ITAÚ FFPREV	Instit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07	D+21	D+24	12.862.082,84	2,82%	9,17%					do IBOV	1.465.473.199	0,88%				
ITAÚ FFPREV	Instit Ações Dunamis FICFIA -24.571.992/0001-75	D+22	D+23	10.874.530,55	10,08%	11,03%					do IBOV	2.886.370.474	0,38%				
AZQUEST FFPREV	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	8.656.695,90	1,90%	11,39%					do SMLL	1.013.500.716	0,9%				
AZQUEST FFPREV	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	6.118.007,72	1,34%	11,36%					do IBOV	699.654.427	0,9%				
AZQUEST FFPREV	SMALL MID CAPS RPPS FIC FIA - 34.791.108/0001-61	D+1	D+29	4.055.530,18	0,89%	11,36%					do IBOV	107.601.562,13	3,8%				
XP Investimentos FFPREV	XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12	D+1	D+4	5.331.473,07	1,17%	4,84%					do IDIV	255.702.459	2,09%				
CEF/Vinci Partner's FFPREV	FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15	D+30	D+33	2.909.502,38	0,98%	7,24%					IDIV	714.263.826	0,41%				
CEFederal FFPREV	FIC ACOES VALOR RPPS CNPJ: 14.507.699/0001-95	D+21	D+23	8.657.552,97	2,91%	9,76%					IDIV	422.453.825	2,05%				
OCCAN FFPREV	OCCAM FIC FIA CNPJ 11.628.883/0001-03	D+1	D+18	9.999.273,24	3,36%	10,22%					do IBOV	529.727.118	1,89%				
PERFIN FFPREV	Perfin Instituc. FIC FIA CNPJ 10.608.762/0001-29	D+30	D+33	733.596,78	0,25%	13,89%					do IBOV	315.583.314	0,23%				
MOAT FFPREV	Moat Capital Advisory FIC FIA CNPJ: 35.354.967/0001-56	D+15	D+17	9.628.406,50	3,23%	21,53%					do IBOV	827.970.951	1,16%				
ICATU FFPREV	Icatu Vang Dividendos FIA 08.279.304/0001-41	D+1	D+5	5.481.183,73	1,20%	6,08%			1,98%		do IDIV	1.392.329.917	0,39%				
Fundo ETF Índices em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"																	
				14.030.268,24	3,08%												
Fundos Multimercados - Aberto (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso III																	
Mongeral Aegon FFPREV	Mongeral Aegon FIM CNPJ 14.115.116/000180	D+1	D+1	2.526.577,31	0,55%	-0,53%					CDI	122.011.346	2,07%				
CEFederal FFPREV	Cap Prot Bolsa II Multim CNPJ 22.790.987/0001-28	D+0	D+821	2.056.857,10	0,69%	1,00%					CDI	102.599.829	2,00%				
Western Asset FFPREV	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	9.446.833,83	2,07%	11,77%					do CDI	773.176.553	1,22%				
				8.564.517,74	1,88%												
Vinci Cap Partners III FFPREV	FIP Multiesratégia II CNPJ 30.507.217/0001-53	Fechado	Fechado	606.219,05	0,13%	-1,07%					IPCA	23.475.833	2,58%				
Kinea IV Feeder FFPREV	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	7.958.298,69	1,75%	-0,04%			1,2316761	171.836.682,00	IPCA	211.558.101	3,76%				
Fundo Imobiliário FI - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"																	
					0,00%												
Fundo de Ações - Mercado de Acesso (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C"																	

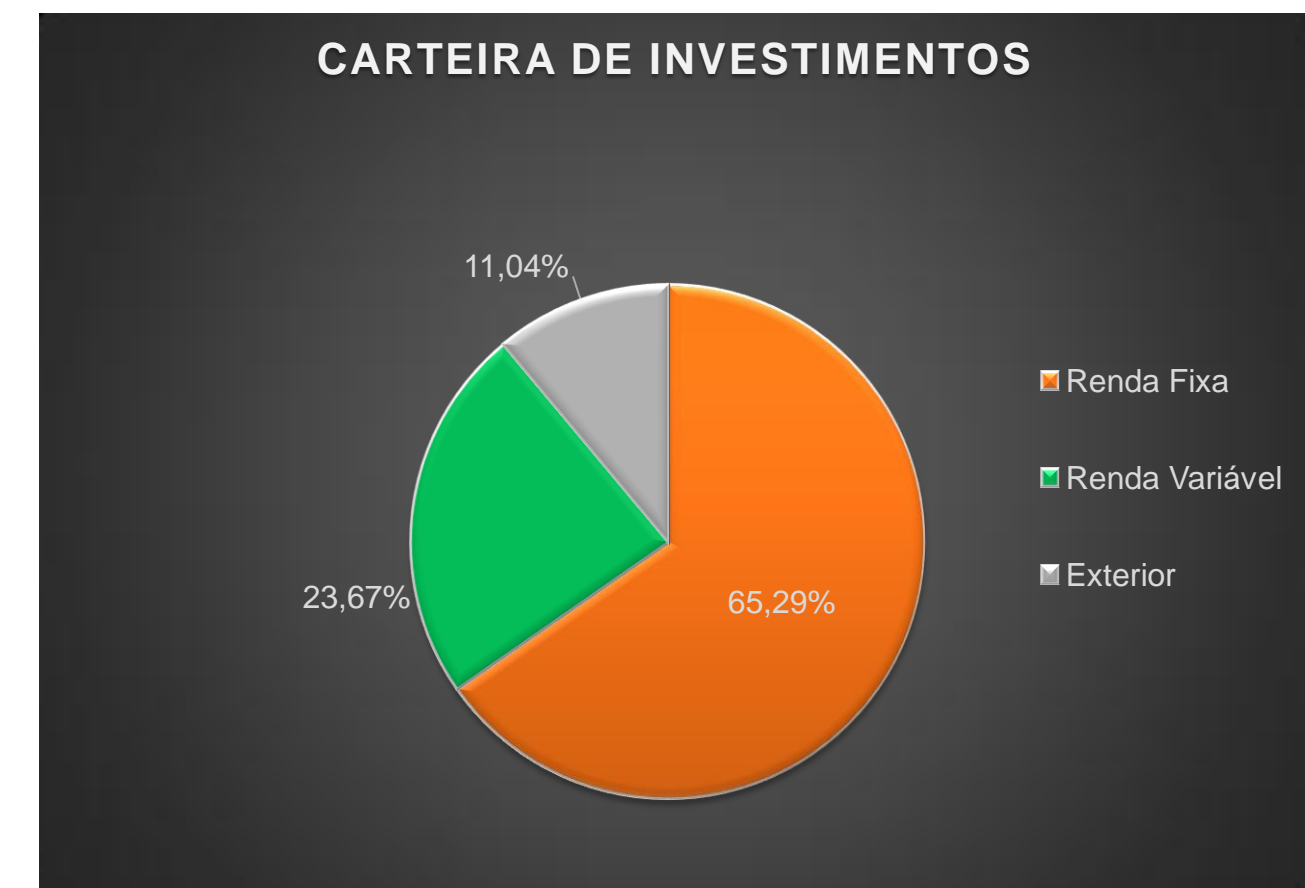
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR																
		50.325.962,10	11,04%					11,04%								
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa (Investimentosno Exterior) - Art. 9º-A, Inciso I								Exterior	0,00%	10%	10%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso I		
Investimento no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso II		39.552.061,02														
SANTANDER FFPREV	GLOBAL EQUITIES IE CNPJ: 17.804.792/0001-50	D+1	D+8	6.211.115,06	1,36%	18,04%	MCSI World	251.486.113,05	2,47%	MM Inv Ext				Art. 9º-A, Inciso II		
BB do Brasil/JP Morgan FFPREV	BB MM GLOBAL SELECT - 17.413.636/0001-68	D+1	D+5	6.977.434,93	1,53%	16,32%	MCSI World	772.588.017	0,9%	MM Inv Ext						
XP Inv/Morgan Stanley	MS GLOBAL OPP FIC FIA IE - CNPJ 33.913.562/0001-85	D+1	D+5	10.513.873,04	3,53%	17,78%	MCSI World	165.085.634	6,37%	Ações Inv Ext	8,68%	10%	10%		5%	
Western Asset FFPREV	LEGG MASON - CNPJ: 28.320.600/0001-56	D+1	D+5	4.981.970,77	1,09%	12,94%	Russel 1000	38.380.541,98	12,98%	Ações Inv Ext						
Western Asset FFPREV	MACRO DOLAR MM IE - CNPJ: 23.872.712/0001-04	D+1	D+5	6.108.909,50	1,34%	9,98%	DOL-D2	60.682.980,94	10,07%	MM Inv Ext						
Western Asset FFPREV	MACRO FIM IE - CNPJ: 22.282.992/0001-20	D+1	D+5	4.758.757,72	1,04%	5,04%	DOL-D3	855.019.574,14	0,56%	MM Inv Ext						
Fundo deAções - BDR-Nível 1 (Investimentosno Exterior) - Art. 9º-A, Inciso III		10.773.901,08														
Western Asset FFPREV	AÇÕES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D+1	D+5	10.773.901,08	2,36%	19,81%	NA	583.127.592,58	1,85%	Ações Inv Ext	2,36%	10%	10%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso III
Disponibilidade de Caixa		0,00														
Disponibilidade em Caixa FFPREV(Santander)																
Disponibilidade em Caixa FFPREV(CEF + Santander + Itaú)		0,00														
TOTAL DE ATIVOS		455.917.089,33		100,00%				100,00%								
Meta Atuarial(INPC+ 4,00%aa)= (-) 0,23 + 0,327374)		0,10%	IBOVESPA	10,25%	IFIX	4,39%	IRF-M	1,15%	FFPREV - Ano	-7,72%						
Rentabilidade no mês SBPCREV FFPREV		4,33%	IBrX	10,27%	IMA-B	1,31%	IRFM 1	0,45%	Meta Atuarial - Ano	1,64%						
INPC		-0,23%	IBRX50	10,49%	IMA-G	0,86%	IRFM 1+	1,50%	FFPREV - 12 meses	5,55%						
CDI		0,28%	SMLL	10,19%	IMA-B 5	0,49%	IMA-C	1,39%	Meta Atuarial - 12 Meses	7,95%						
IPCA		-0,31%	IDIV	3,76%	IMA-B 5+	2,01%	IMA-S	0,27%								
Total FFIN2 + FFINPrev		1.342.075.688,06														

CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Renda Fixa	rentabilidade no mês	0,94%	297.688.505,39	65,29%
Renda Variável	rentabilidade no mês	9,46%	107.902.621,84	23,67%
Exterior	rentabilidade no mês	15,23%	50.325.962,10	11,04%
Disponibilidade Caixa		4,33%	0,00	0,00%
			455.917.089,33	100,00%

		Consolidado	
Renda Fixa		994.127.457,39	66,83%
Renda Variável		430.696.127,83	28,95%
Exterior		59.740.896,63	4,02%
Disponibilidade de Caixa		2.958.034,11	0,20%
Total Geral		1.487.522.515,96	100,00%

FFPREV	Abril 2020	Lim Resol
RENTABILIDADE		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)	49.927.567,18	10,95%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)	196.300.761,72	43,06%
Art. 7º, Inciso I, Alínea C (Índice ETF)	0,00	0,00%
Art. 7º, Inciso II (Op.Compromissadas)	0,00	0,00%
Artigo 7º, Inciso III "A" (Fundos Referenciados)	13.650.608,92	2,99%
Art. 7º, Inciso III, Alínea "B" (Índices ETF Referenciados)	0,00	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV "A" (Fundos RF abertos)	37.809.567,57	8,29%
Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B" (Índices ETF abertos)	0,00	0,00%
Art. 7º, Inciso V, Alínea "B" (Letras Imobiliárias Garantidas)	0,00	0,00%
Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A" (CDB)	0,00	0,00%
Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B" (poupança)	0,00	0,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A" (FIDC cotas Sênior)	0,00	0,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B" (Fundos Crédito Privado)	0,00	0,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C" (Fundos Debêntures InfraEstrutura)	0,00	0,00%
RENTABILIDADE E ESTRUTURADOS	107.902.621,84	23,67%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FIA abertos índices)	0,00	0,00%
Art. 8º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos ETF índices)	0,00	0,00%
Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" (FIA aberto carteira livre)	85.307.835,86	18,71%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)	0,00	0,00%
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)	14.030.268,24	3,08%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)	8.564.517,74	1,88%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliário)	0,00	0,00%
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - FAções - Mercado de Acesso	0,00	0,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	50.325.962,10	11,04%
Art. 9º-A, Inciso I - Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa	0,00	0,00%
Art. 9º-A, Inciso II - Investimento no Exterior	39.552.061,02	8,68%
Art. 9º-A, Inciso III - Fundo deAções - BDR-Nível 1	10.773.901,08	2,36%
Disponibilidade de Caixa	0,00	0,00%



-470,73%

69,81%

455.917.089,33

886.158.598,73

1.342.075.688,06

CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Títulos Públicos	49.927.567,18	10,95%
CEFederal	104.982.464,57	23,03%
Santander	84.561.143,78	18,55%
Banco do Brasil	24.742.273,78	5,43%
Itaú	33.915.973,99	7,44%
Bradesco	14.575.052,84	3,20%
AZQuest	25.446.929,37	5,58%
Western	42.007.938,86	9,21%
Sul América	13.693.135,88	3,00%
ARX Investimentos	0,00	0,00%
Safra	0,00	0,00%
Kinea/Itau	7.958.298,69	1,75%
Icatu Vanguard	11.857.389,02	2,60%
RBCapital	0,00	0,00%
Occan	9.999.273,24	2,19%
Vinci Partner's/CEF	2.909.502,38	0,64%
Ourinvest	0,00	0,00%
Mongeral Aegon	2.526.577,31	0,55%
Reag	0,00	0,00%
XP Investimentos	15.845.346,11	3,48%
BTG	0,00	0,00%
BRZ	0,00	0,00%
TrendBank	0,00	0,00%
BVA	0,00	0,00%
Vinci Partner's	606.219,05	0,13%
Moat	9.628.406,50	2,11%
Perfin	733.596,78	0,16%
Saldo Caixa	0,00	0,00%
TOTAL	455.917.089,33	100,00%

RENDA FIXA

	% do total		% da Rfixa
Títulos Públicos	10,95%	49.927.567,18	16,77%
IMA-B	11,58%	52.805.717,79	17,74%
IMA-B5	23,29%	106.187.603,41	35,67%
IMA-B5 - ATIVO	1,30%	5.937.565,96	1,99%
Alocação Dinâmica	2,23%	10.179.360,60	3,42%
IRF-M	14,47%	65.971.741,61	22,16%
DI + Outros R Fixa	1,46%	6.678.948,84	2,24%
FIDC	0,00%	0,00	0,00%
Total	65,29%	297.688.505,39	100,00%

RENDA VARIÁVEL

	% do total		% da Rvariável
Ações Índice Outros 8-I-a	0,00%	-	0,00%
ETF Ações 8-I-b	0,00%	-	0,00%
Ações Livre Geral 8-II-a	11,01%	50.215.897,63	46,54%
Dividendos Ações Livre Geral 8-II-a	5,80%	26.435.242,33	24,50%
Small Caps Ações Livre Geral 8-II-a	1,90%	8.656.695,90	8,02%
ETF Ações Livre Geral 8-II-b	0,00%	0,00	0,00%
Multimercados 8-III	3,08%	14.030.268,24	13,00%
FIP Fechado 8-IV-a	1,88%	8.564.517,74	7,94%
FImobiliário 8-IV-b	0,00%	-	0,00%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c	0,00%	-	0,00%
Total	23,67%	107.902.621,84	100,00%

EXTERIOR

Renda Fixa -Dívida Externa - 9ªA, inciso I	0,00%	1,00	2E-08
Investimento Exterior 9ªA, inciso II	8,68%	39.552.061,02	0,78592
Ações BDR-Nível 1 - 9ªA, inciso III	2,36%	10.773.901,08	0,21408
	0,00%		0
Total	11,04%	50.325.963,10	1

Disponibilidade Financeira

-

TOTAL

455.917.090,33