

SBCPREV - CONSOLIDADO - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 31/07/2020																		
INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Resgate	Resgate	VLR. APLICADO		Entabilidade		Limites		SEGMENTO / CATEG.	Limite	RESOL 3.922 + Nivel 1 Pro Gestão	Política Invest	%PL do Fundo	Máx PL do RPPS por Fundo	Inquadr. Resol.3922/2010	NORMA	
				Nominal	% Patr do RPPS	Mês	Bechmark	PL do Fundo	% do PL do Fundo									Aplicado RPPS
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																		
Titulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea A																		
2	CEFederal (custodiante)	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2021 - 3.450			232.034.318,31	16,56%												
3	CEFederal (custodiante)	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2023 - 7.600			12.129.152,88	0,87%	4,48%											
4	CEFederal (custodiante)	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2035 - 8.500			29.146.755,97	2,08%	4,48%	4,4840										
5	CEFederal (custodiante)	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2035 - 3.450			37.658.258,73	2,69%	4,48%											
6	CEFederal (custodiante)	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2035 - 6.000			15.284.822,66	1,09%	4,48%											
7	CEFederal (custodiante)	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2035 - 13.000			26.582.300,28	1,90%	4,48%											
8	CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2035 - 4.000			57.594.983,94	4,11%	4,48%											
10	CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2023 - 2.000			17.721.533,52	1,26%	4,48%											
11	CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-8 (ppca) venc 15/08/2026 - 3.400			7.670.198,94	0,55%	4,48%											
12	CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-8 (ppca) venc 15/05/2035 - 3.200			14.069.084,58	1,00%	4,48%											
Fundos Referenciados Renda Fixa que contemham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B																		
13	Santander	FIC FI IMA-B5 Titulos Públ - 13.455.117/0001/01	D=0	D=1	405.502.112,75	28,93%												
14	Santander	FI IRF-M Titulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D=0	D=1	49.828.891,63	3,56%	0,97%	do IMA-B	1.087.480.106	4,58%								
15	Santander FFPREV	FI IMA-B Titulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D=0	D=1	22.628.174,92	1,61%	1,18%	do IMA-B	3.551.848.746	0,64%								
16	Santander FFPREV	FIC FI IMA-B5 Titulos Públ - 13.455.117/0001/01	D=0	D=1	3.612.305,66	0,26%	4,36%	do IMA-B	1.362.475.594	0,27%								
17	Bco do Brasil	FI IRF-M Titulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D=0	D=1	44.710.320,96	3,19%	0,97%	do IMA-B	1.087.480.106	4,11%								
18	Bco do Brasil FFPREV	FI IMA-B Titulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D=0	D=1	12.815.316,34	0,91%	1,18%	do IMA-B	3.551.848.746	0,36%								
19	Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D=0	D=1	24.838.776,63	1,77%	4,36%	do IMA-B	1.362.475.594	1,82%								
20	Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D=0	D=1	17.624.271,89	1,26%	1,13%	do IRF-M	5.350.645.860	0,33%								
21	Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D=0	D=1	12.330.807,78	0,88%	1,13%	do IRF-M	5.350.645.860	0,2%								
22	Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D=0	D=1	7.709.084,96	0,55%	0,97%	do IMA-B5	4.153.926.563	0,19%								
23	Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D=0	D=1	6.074.323,48	0,43%	0,97%	do IMA-B5	4.153.926.563	0,15%								
24	Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF ALOC ATIVA FIC FI - 25.078.994/0001-90	D=0	D=1	20.470.268,02	1,46%	1,77%	do IMA-B6	10.799.663.749	0,19%								
25	Safrá	IMA-B FIC FI - 10.787.822/0001-18	D=3	D=4	21.050.167,16	1,50%	4,78%	do IMA-B	1.231.317.700	1,71%								
26	CEF	FI IMA-B5 RF Tr Titulos Públicos - 11.060.913/0001-10	D=0	D=0	20.446.757,87	1,46%	0,97%	do IMA-B5	12.027.903.791	0,17%								
27	CEF	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D=0	D=0	25.853.462,55	1,84%	1,09%	do IMA-B5	15.544.114.121	0,17%								
28	CEF FFPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D=0	D=0	43.927.945,65	3,13%	1,09%	do IMA-B5	15.544.114.121	0,28%								
29	CEF FFPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TRF - 11.060.913/0001-10	D=0	D=0	40.631.840,56	2,90%	0,97%	do IMA-B5	12.027.903.791	0,34%								
30	Sul América - FFPREV	INFLATE FI RF LP 09.326.708/0001-01	D=1	D=2	14.789.771,25	1,06%	4,24%	do IMA-B	1.351.331.598	1,09%								
31	Western Asset	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D=0	D=1	9.852.465,84	0,70%	1,81%	do IMA-B5	640.279.975	1,54%								
32	Western Asset FFPREV	WA IMABS Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D=0	D=1	6.307.159,60	0,45%	1,81%	do IMA-B6	640.279.975	0,99%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contemham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C																		
Operações Compromissadas Lastreadas 100%em TP do TN - Art. 7º, Inciso II																		
Fundos "Referenciados" em Indicadores RfFixa (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso III, Alínea "A"																		
33	CEF FFPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D=0	D=0	17.221.147,01	1,23%												
34	Mongeral Aegon FFPREV	Mongeral Aegon Infl IMA-B 14.115.118/0001-70	D=0	D=2	14.755.360,73	1,05%	4,40%	do IMA-B	2.998.036.271	0,5%								
35	Mongeral Aegon FFPREV	Mongeral Aegon Infl IMA-B 14.115.118/0001-70	D=0	D=2	2.465.786,28	0,18%	3,00%	do IMA-B	131.740.488									
Fundos de Índice ETF Renda Fixa em Indicadores de Titulos Públicos - Art. 7º, Inciso III, Alínea B																		
Fundos de Renda Fixa Geral - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "A"																		
36	Santander FFIN1-478-8	FIC INSTR RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	215.789.596,70	15,40%												
37	Santander FFIN1-480-9	FIC INSTR RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	400.079,05	0,03%	0,27%	do CDI	1.691.934.948	0,02%								
38	Santander FFIN2-479-9	FIC INSTR RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	146.731,28	0,01%	0,27%	do CDI	1.691.934.948	0,01%								
39	Santander FFIN1-493-3	FIC INSTR RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	779.783,10	0,06%	0,27%	do CDI	1.691.934.948	0,05%								
40	Santander FFPREV-491-9	FIC INSTR RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	-	0,00%	0,00%	do CDI	1.691.934.948	0,00%								
41	Bco do Brasil	BB Previd RF IMA-B - 07.861.554/0001-22	D=0	D=1	171.190,59	0,01%	0,27%	do CDI	1.691.934.948	0,0%								
42	CEF	CAIXA FIC BRASIL GEST ESTR RF - 23.215.097/0001-55	D=0	D=0	38.756.194,59	2,77%	4,39%	do IMA-B	1.510.787.186	2,57%								
43	AZQUEST FFPREV	Yield FIQRF LP CNPJ 16.599.968/0001-16	D=0	D=1	9.057.957,66	0,65%	0,98%	do IMA-B	12.451.209.797	0,07%								
44	ITAÚ	INSTR ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D=0	D=1	6.698.664,31	0,48%	0,56%	do CDI	302.389.201	2,22%								
45	ITAÚ FFPREV	INSTR ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D=0	D=1	12.970.832,24	0,93%	0,55%	IPCA	5.186.154.771	0,25%								
46	ICATU FFPREV	ICatu Vang Infl Curta FI RF 10.922.432/0001-03	D=0	D=1	10.335.670,07	0,74%	0,55%	IPCA	5.186.154.771	0,2%								
47	ICATU	ICatu Vang Infl Curta FI RF 10.922.432/0001-03	D=0	D=1	6.650.905,22	0,47%	1,02%	do IMA-B5	584.781.249	1,14%								
48	Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	D=0	D=1	19.944.795,57	1,42%	1,02%	do IMA-B6	584.781.249	3,41%								
49	Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D=0	D=1	2.679.562,46	0,19%	4,47%	do IMA-B	1.967.216.401	0,14%								
50	Bradesco	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D=0	D=1	12.621.132,11	0,90%	0,97%	do IMA-B5	831.066.922	1,52%								
51	Bradesco	Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	D=0	D=1	77.750.556,17	5,55%	4,47%	do IMA-B	1.967.216.401	3,95%								
52	Bradesco	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D=0	D=1	16.825.542,28	1,20%	0,97%	do IMA-B5	831.066.922	2,02%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Quaisquer Indicadores - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"																		
Letras Imobiliárias Garantidas - 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"																		
53	Durinvest	Suppliercard Senior 1 - 08.692.888/0001-82	D=120	D=121	8.191.111,23	0,58%												
54	BVA	Multisetorial Master II - 11.989.256/0001-90	Fechado	Fechado	8.162.163,66	0,58%	0,53%	do CDI	864.767.563	0,94%								
55	Trend Bank	Senior Multisetorial - 08.927.488/0001-09	Fechado	Fechado	28.947,56	0,00%	662,70%	do CDI	675.444	4,29%								
56	Trend Bank	Senior Multisetorial - 08.927.488/0001-09	Fechado	Fechado	0,01	0,00%	0,00%	do CDI	1	1,00%								
Fundos Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B"																		
Fundos de Debentures de Infraestrutura - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C"																		

Fundo de Ações - BDR-Nível 1 (Investimentos Exterior) - Art. 9º-A, Inciso III				23.851.722,67																		
Western Asset	AÇÕES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D=1	D=5	11.825.364,50	0,84%	2,57%	NA	1.181.976.194	1,00%	Ações Inv Ext	1,70%	10%	10%	15%	20%					Art. 9º-A, Inciso III		
Western Asset	FFPREV	AÇÕES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D=1	D=5	12.026.358,17	0,86%	0,00%	NA	0	#DIV/0!	Ações Inv Ext											
Disponibilidade de Caixa																						
Disponibilidade de Caixa				343.734,98	0,02%						0,02%									0%		
46	Disponibilidade em Caixa FFIN1			277.619,17	0,02%																	
Disponibilidade em Caixa Honorário Sucumbência (BB)				122,02	0,00%																	
Disponibilidade - Saldo Consignados CEF				-	0,00%																	
47	Disponibilidade em Caixa FFIN2(BB+Santander+Itau+CEF)			-	0,00%						Disponibilidade											
Disponibilidade em Caixa FFPREV				65.993,79	0,00%																	
TOTAL DE ATIVOS				1.401.426.329,44	100,00%																	
Meta Atuarial(INPC+ 5,26%aa)+(+) 0,44 + 0,428108)				0,87%	IBOVESPA	8,27%			IRF-M	1,08%	Consolidado -Ano										1,52%	
Rentabilidade no mês SBCPREV Consolidado				3,81%	IBX	8,41%			IRFM 1	0,24%	Meta Atuarial - Ano										3,87%	
INPC				0,44%	IBXS0	8,15%			IRFM 1+	1,47%	Consolidado - 12 meses										8,41%	
CDI				0,19%	SMLL	9,50%			IMA - C	4,26%	Meta Atuarial - 12 Meses											8,43%
IPCA				0,36%	IDIV	6,53%			IMA-S	0,20%												518.104.081,25
Total FFIN2 + FFINPrev				1.401.426.329,44																		883.322.248,19
																						1.401.426.329,44

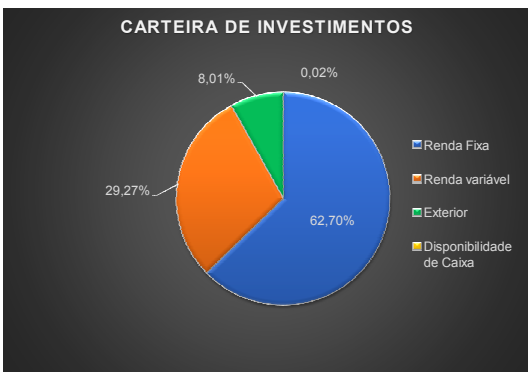
Renda Fixa	rentabilidade no mês	3,66%	878.738.286,00	62,70%	Consolidado	878.738.286	62,70%
Renda Variável	rentabilidade no mês	6,78%	410.144.063,32	29,27%		410.144.063	29,27%
Exterior	rentabilidade no mês	8,01%	112.200.245,14	8,01%		112.200.245	8,01%
Disponibilidade Caixa		0,02%	343.734,98	0,02%		343.735	0,02%
			1.401.426.329,44	100,00%		1.401.426.329	100,00%

VaK

CARTEIRA DE INVESTIMENTO

ANO	META	SBCPREV	DIFER
2011	12,49	11,18	-1,19
2012	12,7	22,41	+9,71
2013	12,03	-6,03	-18,06
2014	12,75	10,45	-2,30
2015	17,81	9,54	-8,27
2016	12,97	20,00	+7,03
2017	8,11	15,30	+7,19
2018	9,58	12,39	+2,81

Renda Fixa	878.738.286,00	62,70%	
Renda variável	410.144.063,32	29,27%	
Exterior	112.200.245,14	8,01%	
Disponibilidade de Caixa	343.734,98	0,02%	
	1.401.426.329,44	100,00%	
Lim Resol			
CONSOLIDADO Junho 2020	1.401.426.329,44	100,00%	100,00%
RENDA FIXA	878.738.286,00	62,70%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)	232.034.318,31	16,56%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)	405.502.112,75	28,93%	100,00%
Art. 7º, Inciso I, Alínea C (índice ETF)	0,00	0,00%	100,00%
Art. 7º, Inciso II (Op.Compromissadas)	0,00	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III "A" (Fundos Referenciados)	17.221.147,01	1,23%	60,00%
Art. 7º, Inciso III, Alínea "B" (Índices ETF Referenciados)	0,00	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV "A" (Fundos RF abertos)	215.789.596,70	15,40%	40,00%
Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B" (Índices ETF abertos)	0,00	0,00%	40,00%
Art. 7º, Inciso V, Alínea "B" (Letras Imobiliárias Garantidas)	0,00	0,00%	20,00%
Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A" (CDB)	0,00	0,00%	15,00%
Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B" (poupança)	0,00	0,00%	15,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A" (FIDC cotas Sênior)	8.191.111,23	0,58%	5,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B" (Fundos Crédito Privado)	0,00	0,00%	5,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C" (Fundos Debêntures InfraEstrutura)	0,00	0,00%	5,00%
RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS	410.144.063,32	29,27%	50,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FIA abertos índices)	0,00	0,00%	30,00%
Art. 8º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos ETF índices)	0,00	0,00%	30,00%
Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" (FIA aberto carteira livre)	326.522.243,63	23,30%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)	0,00	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)	46.209.076,29	3,30%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)	23.656.334,55	1,69%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliário)	13.756.408,85	0,98%	5,00%
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - Fações - Mercado de Acesso	-	0,00%	5,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	112.200.245,14	8,01%	10,00%
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º-A, Inciso I	-	0,00%	10,00%
Investimento no Exterior- Art. 9º-A, Inciso II	88.348.822,47	6,30%	10,00%
Fundo de Ações - BDR-Nível 1 - Art. 9º-A, Inciso III	23.851.722,67	1,70%	10,00%
Disponibilidade de Caixa	343.734,98	0,02%	0,00%



Titulos Públicos	232.034.318,31	16,56%
CEFederal	191.424.265,34	13,66%
Santander	173.385.994,40	12,37%
Banco do Brasil	118.116.117,08	8,43%
Itaú	136.918.521,78	9,77%
Bradesco	109.876.793,02	7,84%
AZQuest	78.881.763,01	5,63%
Western	103.502.403,92	7,39%
ARX Investimentos	33.816.140,86	2,41%
Safra	21.050.167,16	1,50%
Kinea/Itau	19.784.693,60	1,41%
Icatu Vanguard	35.960.050,94	2,57%
Sul América	14.789.771,25	1,06%
Occan	12.967.670,78	0,93%
RBCapital	9.007.008,85	0,64%
Vinci Partner's/CEF	17.190.617,38	1,23%
Ourinvest	8.162.163,66	0,58%
Mongeral Aegon	8.153.371,07	0,58%
Reag	4.749.400,00	0,34%
XP Investimentos	30.809.025,36	2,20%
BTG Pactual	4.451.394,17	0,32%
BRZ	373.626,32	0,03%
TrendBank	0,01	0,00%
BVA	28.947,56	0,00%
Vinci Partner's FIP	1.462.525,83	0,10%
Perfin	1.995.368,09	0,14%
Moat	32.190.474,71	2,30%

Saldo Caixa	343.734,98	0,02%
	1.401.426.329,44	100,00%

RENDA FIXA

	% do total		% da Rfixa	
Titulos Públicos	16,56%	232.034.318,31	26,41%	
IMA-B	14,32%	200.698.480,93	22,84%	
IMA-B5	16,09%	225.443.594,64	25,66%	
IMA-B5 - ATIVO	1,15%	16.159.625,44	1,84%	
Alocação Dinâmica	3,77%	52.834.727,99	6,01%	
IRF-M	9,65%	135.179.979,13	15,38%	
DI + Outros R Fixa	0,58%	8.196.448,33	0,93%	
FIDC	0,58%	8.191.111,23	0,93%	
	62,70%	878.738.286,00	100,00%	0,63

RENDA VARIÁVEL

	% do total		% da Rvariável
Ações Índice 8-I-a	0,00%	-	0,00%
ETF Ações 8-I-b	0,00%	-	0,00%
Ações Livre Geral 8-II-a	14,68%	205.727.038,15	50,16%
Dividendos Ações Livre Geral 8-II-a	5,37%	75.306.400,12	18,36%
Small Caps Ações Livre Geral 8-II-a	3,25%	45.488.805,36	11,09%
ETF Ações Livre Geral 8-II-b	0,00%	0,00	0,00%
Multimercados 8-III	3,30%	46.209.076,29	11,27%
FIP Fechado 8-IV-a	1,69%	23.656.334,55	5,77%
Filomobiliário 8-IV-b	0,98%	13.756.408,85	3,35%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c	0,00%	-	0,00%
Total	29,27%	410.144.063,32	100,00%

EXTERIOR

Renda Fixa -Dívida Externa - 9ªA, inciso I	-	0
Investimento Exterior 9ªA, inciso II	88.348.522,47	78,74%
Ações BDR-Nível 1 - 9ªA, inciso III	23.851.722,67	21,26%

Total	112.200.245,14	100,00%
--------------	-----------------------	----------------

Disponibilidade de Caixa	343.734,98
--------------------------	------------

TOTAL GERAL	1.401.426.329,44
-------------	------------------