

SBPREV - CONSOLIDADO - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 9.922 - BASE: 31/03/2021

INSTITUIÇÕES	FUNDO / CNPJ	Rendimento	Rendimento	VLR. APLICADO	Rentabilidade		Desempenho	PL do Fundo	Limite	% do PL do Fundo	RESC 3.022 - Item 1 Pro Gestão	Política Invest	NPL do Fundo	Máx PL de RPPS por Fundo	Enquad: Resol. 3022/2020	NORMA
					Nominal											
					% Par do RPPS	Mês										
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																
União Pública de Ensino do TN - Art. 7º, inciso I, Alínea A				227.798.086,36		16,73%										
CEFederal (sustentada)	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2021 - 3.450			12.504.737,38		0,92%										
CEFederal (sustentada)	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2023 - 7.600			29.315.972,89		2,15%										
CEFederal (sustentada)	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 8.500			36.729.451,38		2,70%										
CEFederal (sustentada)	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 3.450			14.907.836,15		1,09%										
CEFederal (sustentada)	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 6.000			25.926.671,56		1,90%										
CEFederal (sustentada)	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 13.000			56.174.455,06		4,13%										
EFederal (sustentada) FPREV	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 4.000			17.284.447,71		1,27%										
EFederal (sustentada) FPREV	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2033 - 2.000			7.714.729,71		0,57%										
EFederal (sustentada) FPREV	NTN-B (lpcal) venc 15/08/2026 - 3.400			13.412.226,36		0,99%										
EFederal (sustentada) FPREV	NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 3.200			13.827.558,16		1,02%										
Fundo Referenciado Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, inciso I, Alínea A				386.931.979,42		28,42%										
Santander	FI RRA BS Titulos Púbil - 13.655.117/0001-01			19.032.729,66		1,40%		do IMA-B			1.185.685,562					
Santander	FI RRA BS Titulos Púbil - 13.655.117/0001-03			12.330.577,91		0,93%		do IMA-B			1.939.816,188					
Santander	FI IMA-B Titulos Púbil - 14.504.578/0001-50			11.738.649,11		0,86%		do IMA-B			1.193.793,207					
Santander FFPREV	FI FI RRA BS Titulos Púbil - 13.655.117/0001-01			41.032.045,74		3,01%		do IMA-B			1.185.685,562					
Santander FFPREV	FI RRA BS Titulos Púbil - 13.655.117/0001-03			29.840.313,49		2,19%		do IMA-B			1.939.816,188					
Santander FFPREV	FI IMA-B Titulos Púbil - 14.504.578/0001-50			24.977.172,27		1,83%		do IMA-B			1.193.793,207					
BCo do Brasil	BB Previd RP IMA-B - 07.111.384/0001-69			17.214.886,07		1,28%		do RFE-M			7.393.196,135					
BCo do Brasil FFPREV	BB Previd RP IMA-B - 07.111.384/0001-69			17.044.381,31		0,88%		do RFE-M			7.393.196,135					
BCo do Brasil	BB Previd RP IMA-B - 03.543.447/0001-03			16.863.232,53		1,24%		do IMA-B5			5.244.113,079					
BCo do Brasil FFPREV	BB Previd RP IMA-B - 03.543.447/0001-03			21.053.948,15		1,55%		do IMA-B5			5.244.113,079					
BCo do Brasil	BB Previd RP ALOC ATIVA FC FI - 25.079.994/0001-90			20.392.616,82		1,50%		do IMA-B6			9.507.617,923					
Salifa	IMA-B FC FI - 10.787.822/0001-18			20.745.201,89		1,52%		do IMA-B6			993.570,026					
CEF	FI IMA-B5 RF TE Públicos - 11.060.913/0001-10			3.082.912,15		0,23%		do IMA-B5			1.355.141,615					
CEF	FI RFA-M RF LP - 14.508.605/0001-00			3.624.703,94		0,27%		do IMA-B5			1.953.428,366					
CEF	CAIXA FC BRASIL GEST ESTR RP - 23.213.097/0001-55			4.111.954,32		0,30%		do IMA-B5			15.491.489,347					
CEF FFPREV	FI RFA-M RF LP - 14.508.605/0001-00			40.565.638,74		2,98%		do IMA-B5			1.953.428,366					
CEF FFPREV	CA FI Brasil IMA-B5 TRFIF - 11.060.913/0001-10			42.669.167,09		3,13%		do IMA-B5			1.355.141,615					
CEF FFPREV	CAIXA FC BRASIL GEST ESTR RP - 23.213.097/0001-55			14.407.886,03		1,09%		do IMA-B5			15.491.489,347					
Sul América FFPREV	INFRATE FFI RP LP - 36.706/0001-01			14.933.648,72		1,10%		do IMA-B6			1.216.367,397					
Western Asset	IMA IMA-B5 Alíve FI Renda Fixa CNPJ 13.517.577/0001-38			9.919.951,94		0,73%		do IMA-B5			1.185.329,734					
Western Asset FFPREV	IMA IMA-B5 Alíve FI Renda Fixa CNPJ 13.517.577/0001-38			6.350.361,54		0,47%		do IMA-B6			1.185.329,734					
Fundo de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, inciso I, Alínea C																
Operações Compravendas Lateralizadas (COT) TP do TN - Art. 7º, inciso II																
Fundo "Referenciado" em Indicadores Fixas (podem ter crédito privado) Art. 7º, inciso II, Alínea "A"				17.300.234,33		1,27%										
CEF FFPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90			14.830.003,98		1,09%		do IMA-B			2.867.479,223					
Mongeral Aegon FFPREV	Mongeral Aegon Infr IMA-B - 14.115.116/0001-70			2.470.230,35		0,18%		do IMA-B			225.585,092					
Fundo de Índice ETF Renda Fixa em Indicadores de Títulos Públicos - Art. 7º, inciso II, Alínea B																
Fundo de Renda Fixa Geral - Art. 7º, inciso IV, Alínea "A"				159.090.964,27		11,68%										
Santander FFIN1-478-B	FC Instist RF REF DI - 02.224.354/0001-45			522.425,88		0,04%		do CDI			1.461.303,450					
Santander FFIN1-480-9	FC Instist RF REF DI - 02.224.354/0001-45			0,00		0,00%		do CDI			1.461.303,450					
Santander FFIN2-479-9	FC Instist RF REF DI - 02.224.354/0001-45			0,00		0,00%		do CDI			1.461.303,450					
Santander FFIN1-493-3	FC Instist RF REF DI - 02.224.354/0001-45			0,00		0,00%		do CDI			1.461.303,450					
Santander FFPREV-491-9	FC Instist RF REF DI - 02.224.354/0001-45			0,00		0,00%		do CDI			1.461.303,450					
BCo do Brasil	BB Previd RP IMA-B - 07.861.554/0001-22			23.539.001,99		1,73%		do IMA-B			1.287.864,639					
AZQUEST FFPREV	Vide FIDR LP CNPJ 16.599.968/0001-16			6.675.693,03		0,49%		do CDI			213.550,756					
ITAÚ	Instist ALOC DIN RF - 21.838.150/0001-49			13.018.628,74		0,96%		do IMA-B6			3.580.849,195					
ITAÚ FFPREV	Instist ALOC DIN RF - 21.838.150/0001-49			10.373.756,20		0,76%		do IMA-B6			3.580.849,195					
ITAÚ FFPREV	Itaú Vang Infr Curta RF - 10.922.432/0001-03			6.857.556,82		0,50%		do IMA-B5			921.256,812					
ITACATU	Itaú Vang Infr Curta RF - 10.922.432/0001-03			20.564.504,26		1,51%		do IMA-B6			921.256,812					
Bradesco FFPREV	Bradesco FC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25			2.678.219,63		0,20%		do IMA-B			1.934.702,836					
Bradesco FFPREV	Bradesco FC FI RF - IMA-B - 20.216.216/0001-04			12.965.246,46		0,95%		do IMA-B5			1.065.355,222					
Bradesco	Bradesco FC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25			44.611.551,67		3,28%		do IMA-B			1.934.702,836					
Bradesco	Bradesco FC FI RF - IMA-B - 20.216.216/0001-04			17.284.289,59		1,27%		do IMA-B5			1.065.355,222					
Fundo de Índice ETF Renda Fixa - Queridos Indicadores - Art. 7º, inciso IV, Alínea "B"																
Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, inciso V, Alínea "B"																
Certificados de Depósitos Bancários - CDB (Limitado ao PGC) - Art. 7º, inciso VI, Alínea "A"																
Previdência (Limitado ao PGC) - Art. 7º, inciso VI, Alínea "B"																
Índice Cota Síntese - Art. 7º, inciso VII, Alínea "A"				8.422.955,72		0,62%										
Urnivest	Supervisor Sênior 1 - 08.692.888/0001-82			8.402.038,12		0,62%		do CDI			1.304.929,530					
BVA	Multisector Máster 8 - 11.989.256/0001-90			20.917,59		0,00%		do CDI			488.078					
Trend Bank	Sênior Multisectoral - 08.927.488/0001-09			0,01		0,00%		do CDI			#N/D					
Fundo de Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, inciso VIII, Alínea "B"																
Fundo de Debentures de Infraestrutura - Art. 7º, inciso VII, Alínea "C"																
INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS																
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, inciso I, Alínea "A"				0,00		0,00%										
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, inciso I, Alínea "B"																
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, inciso II, Alínea "A"				310.467.614,95		22,80%										
ITAÚ	Itaú RPI Ações Bcov PGC - 08.817.414/0001-10			7.246.529,64		0,53%		do IBOV			981.481,248					
ITAÚ	RIA Ações Dividendos - 02.869.290/0001-02			13.956.275,76		1,02%		do IBOV			430.791,264					
ITAÚ	Instist Ações Phoenia FA - 21.731.629/0001-07			11.959.029,57		0,88%		do IBOV			1.088.808,596					
ITAÚ FFPREV	Instist Ações Phoenia FA - 21.731.629/0001-07			16.597.708,21		1,23%		do IBOV			1.088.808,596					
ITAÚ	Instist Ações Duramim FICHA - 24.574.992/0001-75			15.907.010,25		1,17%		do IBOV			3.385.111,290					
ITAÚ FFPREV	Instist Ações Duramim FICHA - 24.574.992/0001-76			15.486.193,73		1,14%		do IBOV			3.385.111,290					
ARX Investimentos ²¹	ARX Investim Insti FIC FA - 18.027.318/0001-08			36.785.801,08		2,70% </										

Western Asset FFPREV	EGG MASON - CNPJ: 28.330.600/0001-56	D=1	D=5	6.618.684,94	0,49%	2,73%				Resol 1090	249.813.110	2,65%	Ações Inv Ext							15%	
Western Asset	MACRO DOLAR MM IE - CNPJ: 23.872.712/0001-04	D=1	D=5	6.642.552,50	0,49%	-2,08%				DOL-02	129.469.824	5,33%	MM Inv Ext							5%	
Western Asset FFPREV	MACRO DOLAR MM IE - CNPJ: 23.872.712/0001-05	D=1	D=5	6.642.552,50	0,49%	-2,08%				DOL-02	129.469.824	5,33%	MM Inv Ext							5%	
Western Asset	MACRO FM IE - CNPJ: 22.282.992/0001-20	D=1	D=5	5.026.545,55	0,37%	-3,16%				DOL-03	955.662.330	0,53%	MM Inv Ext							5%	
Western Asset FFPREV	MACRO FM IE - CNPJ: 22.282.992/0001-20	D=1	D=5	5.026.545,55	0,37%	-3,16%				DOL-03	955.662.330	0,53%	MM Inv Ext							5%	
SCHRÖDER	ACES GLOBAS - IE - CNPJ: 37.308.394/0001-50	D=1	D=4	2.862.643,90	0,21%	1,94%				MSCI World	179.286.952	1,60%	Ações Inv Ext							15%	
SCHRÖDER FFPREV	ACES GLOBAS - IE - CNPJ: 37.308.394/0001-50	D=1	D=4	3.079.030,94	0,23%	1,94%				MSCI World	179.286.952	1,72%	Ações Inv Ext							15%	

Resumo de Ações - BDR-Nível 1 (Investimentos Exterio) - Art. 9º-A, Inciso III				30.084.631,64																	
Western Asset	ACES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D=1	D=5	14.915.557,29	1,10%	4,33%				NA	3.092.130.666	0,48%	Ações Inv Ext	2,31%	30%	10%	15%	20%		Art. 9º-A, Inciso III	
Western Asset FFPREV	ACES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D=1	D=5	15.169.074,39	1,11%	4,33%				NA	3.092.130.666	0,49%	Ações Inv Ext								

Disponibilidade de Caixa										8.718.879,22	0,64%	0,64%	0%													
Disponibilidade em Caixa FFIN1										254.037,45	0,02%															
Disponibilidade em Caixa Honorário Sugumbacia (BB)										979,95	0,00%															
Disponibilidade - Saldo Consignador CEF										0,00	0,00%															
Disponibilidade em Caixa FFIN2 (BB+Stender+Itaú+CEF)										7.985.001,47	0,59%															
Disponibilidade em Caixa FFPREV										478.866,35	0,04%															
TOTAL DE ATIVOS										1.361.634.443,25	100,00%	100,00%	100,00%													
Meta Atuarial (INPC+4,807aa)-(+)-0,86+ 0,391461)										3,25%	IBOVESPA	6,00%		IRF	-1,38%	IRFM	-0,84%	Consolidado-Ano								-0,82%

Rentabilidade no mês SBCPREV Consolidado										0,95%	IBRX	6,00%		IMA-B	-0,46%	IRFM 1	0,04%	Meta Atuarial - Ano								3,15%	
INPC										0,86%	IBRX50	6,07%		IMA-G	-0,39%	IRFM 1+	-1,45%	Consolidado - 12 meses									19,85%
CPI										0,20%	SMAL	4,58%		IMA-B-S	0,34%	IMA-C	-0,72%	Meta Atuarial - 12 Meses								12,42%	
IPCA										0,93%	IDIV	7,57%		IMA-B-S+	-1,17%	IMA-S	0,17%									592.970.473,19	

Total FFIN2 + FFINPV **1.361.634.443,25** **100,00%**

Renda Fixa				rentabilidade no mês	0,32%	799.544.220,10	58,72%
Renda Variável				rentabilidade no mês	0,46%	409.831.358,27	30,10%
Exterior				rentabilidade no mês	1,15%	143.539.985,66	10,54%
Disponibilidade de Caixa					0,95%	8.718.879,22	0,64%
						1.361.634.443,25	100,00%

Renda Fixa				Consolidado	799.544.220	58,72%
Renda Variável					409.831.358	30,10%
Exterior					143.539.986	10,54%
Disponibilidade de Caixa					8.718.879	0,64%
Total Geral					1.361.634.443	100,00%

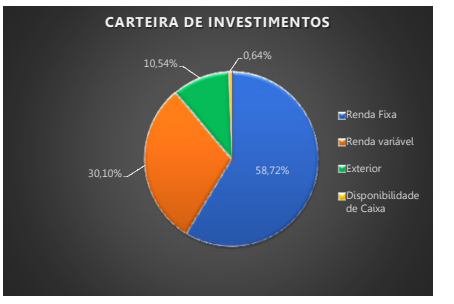
CARTEIRA DE INVESTIMENTO

META	SBCPREV	DIFER	12,49	11,18	-1,19
12,7	22,41	+9,71	12,03	6,03	+8,06
12,75	19,45	-2,30	17,81	9,54	-8,27
12,97	20,00	+7,03	8,11	15,30	+7,19
9,58	12,39	+2,81			

CONSIDERADO Março 2021			1.361.634.443,25	100,00%	100,00%
RENDA FIXA			799.544.220,10	58,72%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (FF Federal)			227.798.086,36	16,73%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos FP)			386.931.979,42	28,42%	100,00%
Art. 7º, Inciso I, Alínea C (Indice ETF)			0,00	0,00%	100,00%
Art. 7º, Inciso II (cap.Compreensividade)			0,00	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III "A" (Fundos Referenciados)			17.300.234,33	1,27%	60,00%
Art. 7º, Inciso III, Alínea "B" (Indices ETF Referenciados)			0,00	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV "A" (Fundos RF abertos)			159.090.964,27	11,68%	40,00%
Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B" (Fundos 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" (poupanca)			0,00	0,00%	15,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A" (FIDC cotas Staker)			8.422.955,72	0,62%	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			409.831.358,27	30,10%	50,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FA 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" (FA abertos carteira livre)			310.467.614,95	22,80%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)			0,00	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)			56.862.779,14	4,18%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FP Fechado)			31.701.505,99	2,33%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (Fundos Investimento)			10.799.458,19	0,79%	5,00%
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - FAPções - Mercado de Acesso			0,00	0,00%	5,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			143.539.985,66	10,54%	10,00%
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º-A, Inciso I			0,00	0,00%	10,00%
Investimento no Exterior - Art. 9º-A, Inciso II			113.455.354,02	8,33%	10,00%
Fundo de Ações - BDR-Nível 1 - Art. 9º-A, Inciso III			30.084.631,64	2,21%	10,00%
Disponibilidade de Caixa			8.718.879,22	0,64%	0,00%

Títulos Públicos			227.798.086,36	16,73%	
CEFederal			167.672.357,93	12,31%	
Santander			157.605.064,00	11,57%	
Banco do Brasil			131.954.478,09	9,69%	
Itaú			107.266.882,60	7,88%	
Bradesco			77.539.307,35	5,69%	
A2Quest			82.571.338,22	6,06%	
Western			117.220.145,33	8,61%	
ASX Investimentos			36.785.801,08	2,70%	
Safra			20.745.201,89	1,52%	
Kineta/Itaú			22.783.501,44	1,67%	
Itaú Vanguard			37.292.121,84	2,74%	
Sul América			14.933.648,72	1,10%	
Ocean			14.282.450,84	1,05%	
RBCapital			6.414.458,19	0,47%	
Vinci Partner's/CEF			19.047.721,58	1,40%	
Oquirvest			8.402.038,12	0,62%	
Monergal Aegon			8.162.039,70	0,60%	
Reag			4.385.000,00	0,32%	
XP Investimentos			37.986.496,31	2,79%	
BTG Pactual			8.479.998,29	0,62%	
BR2			294.204,03	0,02%	
TrendBank			0,01	0,00%	
BVA			20.917,59	0,00%	
Vinci Partner's FIP			2.728.910,33	0,20%	
Perfin			1.924.458,09	0,14%	
Moat			32.677.262,26	2,40%	
SCHRÖDER			5.941.674,84	0,44%	
Saldo Caixa			8.718.879,22	0,64%	

TOTAL GERAL **1.361.634.443,25**



Renda Fixa 58,72%
Renda variável 30,10%
Exterior 10,54%
Disponibilidade de Caixa 0,64%

RENDA FIXA			% do total	% da R/Fixa
Títulos Públicos			16,73%	28,49%
IMA-B			11,79%	20,08%
IMA-B5			14,79%	25,19%
IMA-B5 - ATIVO			1,19%	2,09%
Alocação Dinâmica			4,58%	8,20%
IRF-M			8,49%	14,46%
D + Outros R.Fixa			0,53%	0,90%
FIDC			0,62%	1,05%
Total			58,72%	100,00%

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-I-a			13,29%	44,14%
Dividendos Ações Livre Geral 8-I-a			5,97%	19,55%
Small Caps Ações Livre Geral 8-I-a			3,54%	11,77%
ETF Ações Livre Geral 8-I-b			0,00%	0,00%
Multimercados 8-III			4,18%	13,87%
FIP Fechado 8-IV-a			2,33%	7,74%
Fimobiliário 8-IV-b			0,79%	2,64%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c			0,00%	0,00%
Total			30,10%	100,00%

EXTERIOR				
Renda Fixa - Dívida Externa - 99A, Inciso I			0,00	0
Investimento Exterior 99A, Inciso II			113.455.354,02	79,04%
Ações BDR-Nível 1 - 99A, Inciso III			30.084.631,64	20,96%
Total			143.539.985,66	100,00%
Disponibilidade de Caixa			8.718.879,22	