

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 4.963/2021 - BASE: 30/06/2023

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Conversão	Resgate	VLR. APLICADO		Rentabilidade					Limites	SEGMENTO / CATEGORIA	Limites					NORMA				
				Nominal	% Patr do RPPS	Mês	Ano	12 Meses	24 Meses	% Bechmark ano			PL do Fundo	%/PL do Fundo	Aplicado RPPS	RESOL 4.963 + Nivel 1 Pró Gestão	Politic Invest		% PL do Fundo	Máx PL do RPPS por Fundo	Enquadr. Resol.4963/2021	
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA ART. 7º												61,46%	100,00%									
Carteira Própria - Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso I, Alínea A												31,64%										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400			532.552.263,40	31,64%																	
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2027 - 12.000			14.566.596,33	0,87%	3,22%					IPCA + 6,248 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.450			51.068.875,03	3,03%	3,22%					IPCA + 6,306 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 6.000			15.300.334,26	0,91%	3,22%					IPCA + 6,23 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 8.500			26.609.276,98	1,58%	3,22%					IPCA + 6,49 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 8.500			37.696.475,72	2,24%	3,22%					IPCA + 7,484 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200			14.191.614,39	0,84%	3,22%					IPCA + 7,484 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 13.000			57.653.433,46	3,43%	3,22%					IPCA + 5,688 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000			17.739.517,99	1,05%	3,22%					IPCA + 5,688 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 6.000			27.032.033,15	1,61%	3,22%					IPCA + 4,941 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 5.075			22.864.594,70	1,36%	3,22%					IPCA + 5,235 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 4.925			22.188.793,88	1,32%	3,22%					IPCA + 5,235 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 6.200			27.933.100,92	1,66%	3,22%					IPCA + 5,650 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 6.000			26.652.354,74	1,58%	3,22%					IPCA + 4,961 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 6.300			27.984.972,47	1,66%	3,22%					IPCA + 5,700 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 10.000			44.420.591,23	2,64%	3,22%					IPCA + 5,255 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 12.000			53.304.709,48	3,17%	3,22%					IPCA + 5,703 % aa	do IPCA										
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2050 - 10.000			45.344.988,66	2,69%	3,22%					IPCA + 5,820 % aa	do IPCA										
FI Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B												21,32%										
Bco do Brasil FFPREV	BB PREV. RF ALOC ATIVA RETORNO TOTAL - 35.292.588/0001	D+3	D+3	69.317.237,44	4,12%	1,80%						do IPCA	5.696.060.085,44	1,22%								
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D+0	D+1	12.528.779,27	0,74%	1,03%						do IMA-B5	5.638.426.224,35	0,22%								
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D+0	D+1	16.696.444,21	0,99%	2,09%						do IRF-M	4.459.933.733,33	0,63%								
CEF FFPREV	CAIXA FIC BRASIL GEST ESTR RF - 23.215.097/0001-55	D+0	D+0	33.638.247,12	2,00%	2,10%						do IMA-B5	5.348.206.988,95	0,63%								
CEF FFPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10	D+0	D+0	38.621.296,93	2,29%	1,03%						do IMA-B5	8.254.253.931,25	0,47%								
CEF FFPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D+0	D+0	14.251.175,82	0,85%	2,10%						do IRF-M	1.551.038.458,72	0,92%								
ICATU FFPREV	icatu Yang Infr Curta FI RF - 10.922.432/0001-03	D+0	D+1	33.466.324,75	1,99%	1,00%						do IMA-B5	278.824.529,81	12,00%								
Mongeral Aegon FFPREV	MAG Inflação ALOCACA DINAMICA - 14.115.118/0001-70	D+2	D+3	2.951.808,14	0,18%	2,51%						do IMA-B	170.109.470,65	1,74%								
Santander FFPREV	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ. - 13.455.117/0001-01	D+0	D+1	75.656.486,10	4,50%	1,03%						do IMA-B5	1.128.559.610,31	6,70%								
Santander FFPREV	FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D+0	D+1	43.930.695,94	2,61%	2,37%						do IMA-B	369.070.369,54	11,90%								
Santander FFPREV	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D+0	D+1	14.016.429,10	0,83%	2,10%						do IRF-M	564.902.478,39	2,48%								
Sul América - FFPREV	INFLATIE FI RF LP - 09.326.708/0001-01	D+1	D+2	3.755.447,29	0,22%	1,85%						do IMA-B	178.449.572,96	2,10%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C												0,00%	100%	0%	100%	100%		Art. 7º, Inciso I, Alínea C				
Operações Compromissadas com Lastro em TPF - Art. 7º, Inciso II												0,00%						Art. 7º, Inciso II				
Fundos de Renda Fixa conforme CVM Art. 7º, Inciso III, Alínea A												7,84%										
Santander FFPREV 491-9	DI Institucional Premium - 02.224.354/0001-45	D+0	D+0	2.584.826,95	0,15%	0,74%						do CDI	3.033.505.723,77	0,09%								
Bco do Brasil FFPREV Migr	BB Previd RF IMA-B - 07.861.554/0001-22	D+0	D+1	16.291.477,89	0,97%	2,39%						do IMA-B	746.954.336,58	2,18%								
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D+0	D+1	36.916.969,62	2,19%	1,03%						do IMA-B5	963.196.862,82	3,83%								
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF IMA-B5 - 08.702.798/0001-25	D+0	D+1	22.964.376,80	1,36%	2,38%						do IMA-B	379.962.570,16	6,04%								
CEF FFPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D+0	D+0	17.750.412,06	1,05%	2,37%						do IMA-B	1.330.366.206,19	1,33%								
ITAÚ FFPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D+0	D+1	11.245.257,92	0,67%	2,22%						do IPCA	2.099.537.000,43	0,54%								
RIO BRAVO FFPREV	Rio Bravo Estratégico IMA-B FI RF - 49.232.373/0001-87	D+1	D+1	16.215.417,00	0,96%	1,60%						do IMA-B	136.417.340,16	11,89%								
RIO BRAVO FFPREV	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF - 50.533.505/0001-90	D+1	D+2	7.970.910,76	0,47%	-0,57%						do IMA-B	223.357.903,09	3,57%								
Fundos de Índice ETF - Conforme CVM - Art. 7º, Inciso III, Alínea B												0,00%	65%	60%	15%	20%		Art. 7º, Inciso III, Alínea "B"				
Ativos Financeiros de RF de emissão com obrigação ou cobrimento de Inst. Financeiras Bancárias autorizadas pelo BACEN-CDB, LFT, etc. - Art. 7º, Inciso IV												0,00%	20%	20%	-	-		Artigo 7º, Inciso IV				
Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - FIDC Cota Sênior - Art. 7º, Inciso V, Alínea A												0,66%										
Ourinvest FFPREV Migr	Suppliercard Senior 1 - 08.692.888/0001-82	D+120	D+121	10.983.571,17	0,65%	1,24%						do CDI	1.459.594.026,10	0,75%								
BVA FFPREV Migr	Multisetorial Master II - 11.989.256/0001-90	Fechado	Fechado	55.277,22	0,00%	14,27%						do CDI	1.519.115,55	3,64%								
Trend Bank FFPREV Migr	Senior Multisetorial - 08.927.488/0001-09	Fechado	Fechado	0,01	0,00%	0,00%						do CDI	0,01									
Fundos de Renda Fixa com sufixo 'Crédito Privado' - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"												0,00%	5%	5%	5%	20%		Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"				
Cotas de Fundo de Investimento - Lei 12.431 - com 85% do PL aplicado em Debêntures Incentivadas - Art. 7º, Inciso V, Alínea C												0,00%	5%	5%	5%	20%		Art. 7º, Inciso V, Alínea C				

Meta Atuarial (INPC+ 4,76%aa)= (-) 0,10 + 0,388267)
 Rentabilidade no mês SBCPREV FFPREV
 INPC
 CDI
 IPCA

0,29%
 3,26%
 -0,10%
 1,07%
 -0,08%

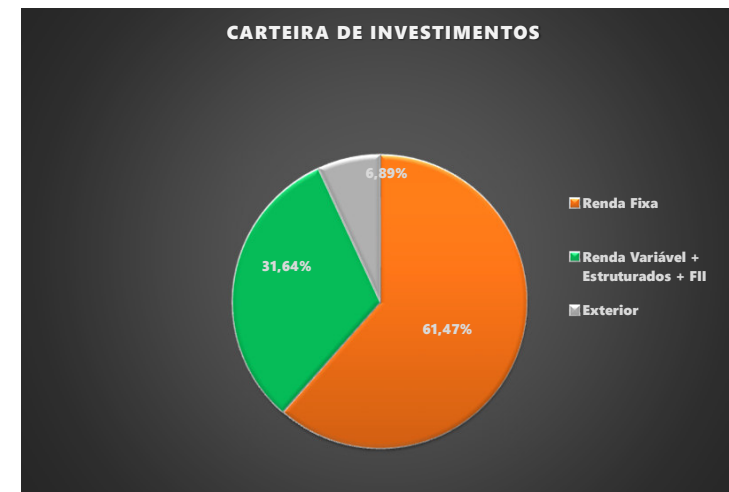
FFPREV - Ano
 Meta Atuarial - Ano
 FFPREV - 12 meses
 Meta Atuarial - 12 Meses

9,65%
 5,07%
 13,33%
 7,50%

1.683.000.297,70

CARTEIRA DE INVESTIMENTO			
Renda Fixa	rentabilidade no mês	2,44%	1.034.361.132,91
Renda Variável + Estruturados + FII	rentabilidade no mês	6,04%	532.383.324,46
Exterior	rentabilidade no mês	-1,57%	115.992.693,90
Consignados			0,00
Total dos Investimentos			1.682.737.151,27
Disponibilidade Caixa			263.146,43
Total Geral		3,26%	1.683.000.297,70

Lim Resol			
FFPREV	Junho 2023	1.683.000.297,70	100,00%
RENDA FIXA ART. 7º		1.034.361.132,91	61,46%
Carteira Própria - Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso I, Alínea A		532.552.263,40	31,64%
FI Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B		358.830.372,11	21,32%
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C		0,00	0,00%
Operações Compromissadas com Lastro em TPF - Art. 7º, Inciso II		0,00	0,00%
Fundos de Renda Fixa conforme CVM Art. 7º, Inciso III, Alínea A		131.939.649,00	7,84%
Fundos de Índice ETF - Conforme CVM - Art. 7º, Inciso III, Alínea B		0,00	0,00%
Ativos Financeiros de RF de emissão com obrigação ou coobrigação de Inst. Financeiras Bancárias autorizadas pelo BACEN-CDB, LFT, etc. - Art. 7º, Inciso IV		0,00	0,00%
Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - FIDC Cota Sênior - Art. 7º, Inciso V, Alínea A		11.038.848,40	0,66%
Fundos de Renda Fixa com sufixo 'Crédito Privado' - Art. 7º, Inciso V, Alínea B		0,00	0,00%
Cotas de Fundo de Investimento - Lei 12.431 - com 85% do PL aplicado em Debêntures Incentivadas - Art. 7º, Inciso V, Alínea C		0,00	0,00%
RENDA VARIÁVEL ART. 8º		319.525.449,09	18,99%
Fundo de Ações em Geral - CVM - Art. 8º, Inciso I		319.525.449,09	18,99%
Fundo de Índice - ETF Renda variável - CVM - Art. 8º, Inciso II		0,00	0,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR ART. 9º		115.992.693,90	6,89%
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa - Investimentos no Exterior - Art. 9º, Inciso I		0,00	0,00%
Fundo de Investimentos em Cotas - FIC - Art. 9º, Inciso II		92.317.028,90	5,49%
Fundo de Ações - BDR Nível 1s - FIC - Art. 9º, Inciso III		23.675.665,00	1,41%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS ART. 10º		203.841.634,70	12,11%
Fundo de Investimentos em Multimercado Art. 10º, Inciso I		136.635.513,75	8,12%
Fundo de Investimentos em Participação Art. 10º, Inciso II		67.206.120,95	3,99%
Fundo de Ações - Mercado de Acesso Art. 10º, Inciso III		0,00	0,00%
FUNDOS IMOBILIÁRIOS ART. 11º		9.016.240,67	0,54%
Fundo de Investimentos Imobiliário Art. 11º		9.016.240,67	0,54%
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS ART. 12º		0,00	0,00%
Empréstimos Consignados Art. 12º		0,00	0,00%
Disponibilidade de Caixa		263.146,43	0,02%



CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Titulos Públicos	532.552.263,40	31,64%
Banco do Brasil	157.191.625,77	9,34%
CEFederal	155.425.218,58	9,24%
Santander	151.064.886,83	8,98%
Rio Bravo	90.492.241,64	5,38%
Itaú	86.980.189,71	5,17%
BTG Pactual	76.320.828,92	4,53%
XP Investimentos	65.378.520,41	3,88%
AZQuest	64.145.321,56	3,81%
Bradesco	59.881.346,42	3,56%
Vinci Partners/CEF	50.875.367,01	3,02%
ARX Investimentos	34.410.828,85	2,04%
Icatu Vanguard	33.466.324,75	1,99%
Kinea/Itaú	25.129.970,24	1,49%
Tarpon	22.920.736,19	1,36%
Vinci Partner's	17.165.438,95	1,02%
Mongeral Aegon	15.598.661,70	0,93%
Occam	13.997.302,11	0,83%
Ourinvest	10.983.571,17	0,65%
SCHRÖDER	5.349.620,91	0,32%
Reag	4.700.000,00	0,28%
RBCapital	4.316.240,67	0,26%
Sul América	3.755.447,29	0,22%
BRZ	579.920,96	0,03%
BVA	55.277,22	0,00%
TrendBank	0,01	0,00%
Saldo Caixa	263.146,43	0,02%
TOTAL	<u>1.683.000.297,70</u>	<u>100,00%</u>

RENDA FIXA			
	% do total		% da Rfixa
Títulos Públicos	31,64%	532.552.263,40	51,90%
IMA-B	6,69%	112.663.320,74	10,98%
IMA-BS	11,72%	197.189.856,67	19,22%
IPCA	0,47%	7.970.910,76	0,78%
Alocação Dinâmica	6,96%	117.152.550,62	11,42%
IRF-M	2,67%	44.964.049,13	4,38%
DI + Outros R Fixa	0,15%	2.584.826,95	0,25%
FIDC	0,66%	11.038.848,40	1,08%
Total	60,97%	1.026.116.626,67	100,00%
RENDA VARIÁVEL			
			% da Rvariável
Ações em Geral 8-I	18,99%	319.525.449,09	100,00%
ETF Ações 8-II	0,00%	0,00	0,00%
Total	18,99%	319.525.449,09	100,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
	% do total		% dos IE
Renda Fixa - Dívida Externa - 9-I	0,00%	0,00	0,00%
FIC 9-II	5,49%	92.317.028,90	79,59%
Ações BDR-Nível 1 - 9-III	1,41%	23.675.665,00	20,41%
Total	6,89%	115.992.693,90	100,00%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
	% do total		% dos Inv. Estruturados
Multimercado 10-I	8,12%	136.635.513,75	67,03%
FIP 10-II	3,99%	67.206.120,95	32,97%
Ações - Mercado de Acesso 10-III	0,00%	0,00	0,00%
Total	12,11%	203.841.634,70	100,00%
FUNDOS IMOBILIÁRIOS			
	% do total		% Dos FIs
FImobiliário 11	0,54%	9.016.240,67	100,00%
Total	0,54%	9.016.240,67	100,00%
Empréstimos Consignados			
			% Dos Consignados
Emp. Consignados 12	0,00%	0,00	0,00%
Total		0,00	
Disponibilidade Financeira	0,02%	263.146,43	
TOTAL	99,51%	1.674.755.791,46	