

SBCPREV - FIN2 - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 28/02/2019																			
INSTITUIÇÕES		FUNDOS / CNPJ		Resgate		VLR. APLICADO		Rentabilidade		Limites		SEGMENTO / CATEG		Limites		NORMA			
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																			
				Nominal	% Patr	Mês	Exercício	% Benchmark	PL do Fundo				Aplicado RPPS	RESOL 3.922	Política Invest	%PL do Fundo	Máx Pl do RPPS por Fundo	Enquadr. Resol.3922/2010	
Títulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea A				182.504.318,88	20,51%														
CEFederal (custodiante)	NTN-B (pca) venc 15/05/2019 - 8.000			26.094.543,55	2,93%	0,74%	1999	1,99%	do IMA-B	1.279.258.880	6,44%								
CEFederal (custodiante)	NTN-B (pca) venc 15/05/2021 - 3.450			11.812.395,80	1,33%	0,66%	2021	0,66%	do IMA-B	1.642.125.391	1,71%								
CEFederal (custodiante)	NTN-B (pca) venc 15/05/2023 - 7.600			26.468.665,47	2,97%	0,34%	2023	0,34%	do IMA-B	1.491									
CEFederal (custodiante)	NTN-B (pca) venc 15/05/2035 - 8.500			32.442.457,82	3,65%	0,84%	2035	0,84%	do IMA-B	7.484 % aa									
CEFederal (custodiante)	NTN-B (pca) venc 15/05/2035 - 13.000			49.617.876,67	5,58%	0,84%	2035	0,84%	do IMA-B	5,688 % aa									
CEFederal (custodiante)	NTN-B (pca) venc 15/05/2035 - 3.450			13.167.821,11	1,48%	0,84%	2035	0,84%	do IMA-B	6,23 % aa									
CEFederal (custodiante)	NTN-B (pca) venc 15/05/2035 - 6.000			22.900.558,46	2,57%	0,84%	2035	0,84%	do IMA-B	6,49 % aa									
Fundos Referenciados Renda Fixa que contêm 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B				299.784.634,08	33,69%														
Santander	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ. -13.455.117/0001/01	D=0	D=1	82.355.854,28	9,25%	0,53%	2019	0,53%	do IMA-B	1.279.258.880	6,44%								
Santander	FI IRF-M Títulos Públ. RF -13.455.197/0001-03	D=0	D=1	28.119.063,76	3,16%	0,28%	2019	0,28%	do IMA-B	1.642.125.391	1,71%								
Santander	FI IMA-B Títulos Públ. RF -14.504.578/0001-90	D=0	D=1	741.704,85	0,08%	-0,17%	2019	-0,17%	do IMA-B	713.687.070	0,10%								
Bco do Brasil	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D=0	D=1	24.302.873,24	2,73%	0,28%	2019	0,28%	do IRF-M	5.408.545.142	0,45%								
Bco do Brasil	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D=0	D=1	16.138.794,36	1,81%	0,52%	2019	0,52%	do IMA-B5	3.203.234.476	0,50%								
Safra	IMA-B FIC FI - 10.787.822/0001-18	D=3	D=4	14.647.345,92	1,65%	0,43%	2019	0,43%	do IMA-B	344.143.038	4,26%								
CEF	FI IMA-B5 RF Títulos Públicos -11.060.913/0001-10	D=0	D=0	57.848.107,89	6,50%	0,52%	2019	0,52%	do IMA-B5	9.015.548.853	0,64%								
CEF	FI IRF-M RF LP -14.508.605/0001-00	D=0	D=0	68.056.746,83	7,65%	0,28%	2019	0,28%	do IMA-B5	2.577.321.443	2,64%								
ITAÚ	Instit RF FIC IMA B5 - 09.093.819/0001-15	D=0	D=0	7.574.142,95	0,85%	0,51%	2019	0,51%	do IMA-B5	1.183.868.305	0,64%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contêm 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C																			
Operações Compromissadas Listradas 100%em TP do TN - Art. 7º, Inciso II																			
Fundos "Referenciados" em Indicadores Rfixa (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso III, Alínea "A"																			
Fundos de Índice ETF Renda Fixa em Indicadores de Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso III, Alínea B																			
Fundos de Renda Fixa Geral - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "A"				218.173.777,33	24,52%														
Santander FFIN1-478-8	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	662.398,58	0,07%	0,45%	2019	0,45%	do CDI	4.404.107.230	0,02%								
Santander FFIN1-480-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-46	D=0	D=0	116.070,13	0,01%	0,00%	2019	0,00%	do CDI	4.404.107.230	0,00%								
Santander FFIN2-479-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-47	D=0	D=0	701.764,55	0,08%	0,00%	2019	0,00%	do CDI	4.404.107.230	0,02%								
Bco do Brasil	BB Previd RF IMA-B - 07.861.554/0001-22	D=0	D=1	50.819.812,24	5,71%	0,52%	2019	0,52%	do IMA-B	1.095.169.533	4,64%								
AZQUEST	Yield FIQRF LP CNPJ -16.599.968/0001-16	D=0	D=1	17.030.898,84	1,91%	0,32%	2019	0,32%	do CDI	198.281.445	8,59%								
ITAÚ	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D=0	D=1	28.833.387,05	3,24%	0,34%	2019	0,34%	do IMA-B	1.210.081.401	2,38%								
Bradesco	Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	D=0	D=1	64.711.088,62	7,27%	0,52%	2019	0,52%	do IMA-B	1.386.130.088	4,67%								
Bradesco	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D=0	D=1	30.060.340,76	3,38%	0,49%	2019	0,49%	do IMA-B5	650.717.575	4,62%								
Bradesco	FI RF DI Premium - 03.399.411/0001-90	D=0	D=0	7.920.248,91	0,89%	0,48%	2019	0,48%	do CDI	7.205.090.345	0,11%								
ICATU	Icatu Vang Infl Curta FI RF - 10.922.432/0001-03	D=0	D=1	17.317.767,65	35,91%	0,52%	2019	0,52%	do IMA-B5	330.726.404	5,24%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Quilques 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"				7.547.950,78	0,85%														
Ourinvest	Suppliercard Senior I - 08.692.888/0001-82	D=120	D=121	7.496.652,12	0,84%	0,58%	2019	0,58%	do CDI	657.597.320	1,14%								
BVA	Multisetorial Master II - 11.989.256/0001-90	Fechado	Fechado	27.151,98	0,00%	0,97%	2019	0,97%	do CDI	627.482	4,33%								
Trend Bank	Senior Multisetorial - 08.927.488/0001-09	Fechado	Fechado	24.146,68	0,00%	-7,99%	2019	-7,99%	do CDI	1.497.434	1,61%								
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																			
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"				5.822.403,99	0,65%														
ITAÚ	Itaú RPI Ações Ibov FICFI - 08.817.414/0001-10	D=2	D=5	5.822.403,99	0,65%	-1,60%	2019	-1,60%	do IBOV	916.641.301	0,64%								
Fundos ETF Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"																			
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "A"				124.808.439,85	14,02%														
ITAÚ	FIA Ações Dividendos -02.887.290/0001-62	D=1	D=1	11.903.862,24	1,34%	-2,57%	2019	-2,57%	do IBOV	292.921.048	4,06%								
ITAÚ	Instit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07	D=21	D=24	48.220.213,18	5,42%	-1,49%	2019	-1,49%	do IBOV	1.416.041.153	3,41%								
ARX Investimentos ²⁾	ARX Income FI Ações Divid - 03.168.062/0001-03	D=1	D=4	28.286.693,67	3,18%	-1,99%	2019	-1,99%	do IBOV	417.364.467	6,78%								
AZQUEST	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D=27	D=28	24.707.312,23	2,78%	-2,88%	2019	-2,88%	do IBOV	852.091.678	2,90%								
AZQUEST	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D=1	D=4	3.173.591,38	0,36%	-2,38%	2019	-2,38%	do IBOV	883.208.554	0,36%								
Vinci Partner's/CEF	FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15	D=30	D=33	8.516.767,15	0,96%	0,39%	2019	0,39%	IDIV	532.993.458	1,60%								
Fundo ETF Índices em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"																			
Fundos Multimercados - Aberto (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso III				25.129.034,07	2,82%														
AZQUEST	AZQuest Equity Hedge FIM CNPJ 09.141.893/0001-60	D=4	D=6	5.084.414,88	0,57%	-0,11%	2019	-0,11%	do CDI	308.574.529	1,65%								
Mongeral Aegon	Mongeral Aegon FIM CNPJ 14.115.116/000180	D=1	D=1	4.943.243,53	0,56%	0,26%	2019	0,26%	do CDI	154.390.634	3,20%								
Western Asset	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D=0	D=1	15.101.375,66	1,70%	3,40%	2019	3,40%	do CDI	818.527.032	1,84%								
Fundo de Participações - FIP - (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"				10.892.325,27	1,22%														
Kinea II	FIP CNPJ 16.437.148/0001-28	Fechado	Fechado	8.358.619,96	0,94%	-19,43%	2019	-19,43%	do IPCA	59.311.715	14,09%								
Kinea IV Feeder	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	587.738,20	0,07%	-2,57%	2019	-2,57%	do IPCA	24.055.972	2,44%								
BRZ Brasil Portos	FIP CNPJ 14.737.553/0001-36	Fechado	Fechado	383.061,92	0,04%	-0,14%	2019	-0,14%	do IPCA	178.423.684	0,21%								
BTG Pactual	FIP Infraestr II CNPJ 14.584.094/0001-06	Fechado	Fechado	1.562.905,19	0,18%	9,46%	2019	9,46%	do IPCA	362.022.082	0,43%								
Fundo Imobiliário FI - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"				15.266.857,17	1,72%														
Reag Renda Imob DOMC11	REAG FI - 17.374.696/0001-19 (10.000 quotas)	Fechado	Fechado	5.500.000,00	0,62%	3,77%	2019	3,77%	do CDI	134.409.000	4,09%								
RB Capital RBRD11	FI Renda II - 09.006.914/0001-34 (107.933 quotas)	Fechado	Fechado	9.766.857,17	1,10%	0,84%	2019	0,84%	do CDI	167.568.115	5,83%								
Fundo de Ações - Mercado de Acesso (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C"																			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR																			
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso I																			
Investimento no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso II																			

Renda Fixa
Renda Variável
Disponibilidade de Caixa

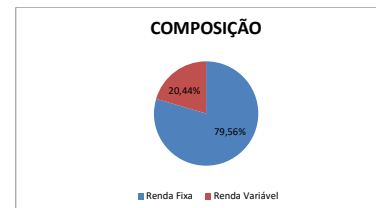
rentabilidade no mês **0,72%**
rentabilidade no mês **-1,94%**
Disponibilidade de Caixa **0,17%**

708.010.681,07
181.919.060,35
18.668,52
889.948.409,94

79,56%
20,44%
0,00%
100,00%

Renda Fixa
Renda Variável
Disponibilidade de Caixa
Total Geral

Consolidado
873.650.798 82,78%
181.682.511 17,22%
13.995 0,00%
1.055.347.305 100,00%



FFIN2 Fevereiro 2019

	889.948.409,94	100,00%	100,00%
REDA FIXA	708.010.681,07	79,56%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)	182.504.318,88	20,51%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)	299.784.634,08	33,69%	100,00%
Art. 7º, Inciso I, Alínea C (Índice ETF)	-	0,00%	100,00%
Art. 7º, Inciso II (Op.Compromissadas)	-	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III "A" (Fundos Referenciados)	-	0,00%	60,00%
Art. 7º, Inciso III, Alínea "B" (Índices ETF Referenciados)	-	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV "A" (Fundos RF abertos)	218.173.777,33	24,52%	40,00%
Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B" (Índices ETF abertos)	-	0,00%	40,00%
Art. 7º, Inciso V, Alínea "B" (Letras Imobiliárias Garantidas)	-	0,00%	20,00%
Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A" (CDB)	-	0,00%	15,00%
Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B" (poupança)	-	0,00%	15,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A" (FIDC cotas Sênior)	7.547.950,78	0,85%	5,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B" (Fundos Crédito Privado)	-	0,00%	5,00%
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C" (Fundos Debêntures InfraEstrutura)	-	0,00%	5,00%
REDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS	181.919.060,35	20,44%	50,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FIA abertos índices)	5.822.403,99	0,65%	30,00%
Art. 8º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos ETF índices)	-	0,00%	30,00%
Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" (FIA aberto carteira livre)	124.808.439,85	14,02%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)	-	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)	25.129.034,07	2,82%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)	10.892.325,27	1,22%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliário)	15.266.857,17	1,72%	5,00%
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - Fações - Mercado de Acesso	-	0,00%	5,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	-	0,00%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso I - Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa	-	0,00%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso II - Investimento no Exterior	-	0,00%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso III - Fundo de Ações - BDR-Nível 1	-	0,00%	10,00%
Disponibilidade de Caixa	18.668,52	0,00%	0,00%

Lim Resol

TOTAL	889.948.409,94	100,00%
Títulos Públicos	182.504.318,88	20,51%
CEFederal	125.904.854,72	14,15%
Santander	112.696.856,15	12,66%
Banco do Brasil	91.261.479,84	10,25%
Itaú	102.354.009,41	11,50%
Bradesco	102.691.678,29	11,54%
AZQuest	49.996.217,33	5,62%
Western	15.101.375,66	1,70%
ARX Investimentos	28.286.693,67	3,18%
Safra	14.647.345,92	1,65%
Kinea/Itaú	8.946.358,16	1,01%
Icatu Vanguard	17.317.767,65	1,95%
RBCapital	9.766.857,17	1,10%
Vinci Partner's/CEF	8.516.767,15	0,96%
Quirinvest	7.496.652,12	0,84%
Mongeral Aegon	4.943.243,53	0,56%
Reag	5.500.000,00	0,62%
XP Investimentos	0	0,00%
BTG	1.562.905,19	0,18%
BRZ	383.061,92	0,04%
TrendBank	24.146,68	0,00%
BVA	27.151,98	0,00%
	18.668,52	0,00%
Saldo Caixa		

	% do total		% da Rfixa
Títulos Públicos	20,51%	182.504.318,88	25,78%
IMA-B	14,71%	130.919.951,63	18,49%
IMA-B5	23,74%	211.295.007,89	29,84%
IMA-B5 - ATIVO	0,00%	0,00	0,00%
Alocação Dinâmica	3,24%	28.833.387,05	4,07%
IRF-M	13,54%	120.478.683,83	17,02%
DI + Outros R Fixa	2,97%	26.431.381,01	3,73%
FIDC	0,85%	7.547.950,78	1,07%
	79,56%	708.010.681,07	100,00%