

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 30/09/2019																						
INSTITUIÇÕES		FUNDOS / CNPJ		Resgate	Resgate	VLR. APLICADO		Rentabilidade			Limites		SEGMENTO / CATEGORIA		Limites					NORMA		
						Nominal	% Patr	Mês	Exercício	% Bechmark ano	PL do Fundo	%			Aplicado RPPS	RESOL 3.922	Politic Invest	%PL do Fundo	Máx Pl do RPPS por Fundo	Enquadr.Resol.3922/2010		
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																						
Títulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea A						52.048.956,52		12,39%														
CEFederal (custodiante) FFINPREV		NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 2.000				7.466.007,38	1,78%	1,09%	IPCA + 6,35 % aa		3,0690%											
CEFederal (custodiante) FFINPREV		NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400				13.252.059,75	3,16%	0,94%	IPCA + 6,248 % aa					12,39%		100%		40%		Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A"		
CEFederal (custodiante) FFINPREV		NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000				17.406.049,66	4,14%	0,57%	IPCA + 5,688 % aa													
CEFederal (custodiante) FFINPREV		NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200				13.924.839,73	3,32%	0,57%	IPCA + 7,484 % aa													
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B						229.295.604,91		54,59%														
Santander FFPREV		FIC FI IMA-B5 Títulos Públ. - 13.455.117/0001/01		D=0	D=1	50.010.179,11	11,91%	1,72%	do IMA-B		1.300.830.938	3,84%										
Santander FFINPREV		FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03		D=0	D=1	11.899.561,24	2,83%	1,43%	do IMA-B		2.625.561.331	0,45%										
Santander FFPREV		FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90		D=0	D=1	23.637.923,37	5,63%	2,84%	do IMA-B		1.311.190.601	1,80%										
Bco do Brasil FFINPREV		BB Previd IRF RF-M - 07.111.384/0001-69		D=0	D=1	17.500.066,17	4,17%	1,42%	do IRF-M		5.223.400.089	0,34%										
Bco do Brasil FFINPREV		BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03		D=0	D=1	12.584.894,92	3,00%	1,72%	do IMA-B5		4.506.301.526	0,28%									Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
CEF FFINPREV		FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00		D=0	D=0	39.894.781,37	9,50%	1,72%	do IMA-B5		7.442.982.485	0,54%										
CEF FFINPREV		CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10		D=0	D=0	53.863.953,61	12,82%	1,72%	do IMA-B5		10.040.403.128	0,54%										
Sul América - FFINPREV		INFPLATIE FI RF LP 09.326.708/0001-01		D=1	D=2	14.155.791,93	3,37%	2,59%	do IMA-B		1.830.422.257	0,77%										
Western Asset FFINPREV		WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78		D=0	D=1	5.748.453,19	1,37%	2,14%	do IMA-B5		506.807.314	1,13%										
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C														Renda Fixa TP		0%		100%		Art. 7º, Inciso I, Alínea C		
Operações Compromissadas Lastreadas 100%em TP do TN - Art. 7º, Inciso II														Renda Fixa TP		0%		5%		Art. 7º, Inciso II		
Fundos "Referenciados" em Indicadores RfIaa (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso III, Alínea "A"						28.623.202,62		6,81%								Renda Fixa Referenciado						
CEF FFINPREV		Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90		D=0	D=0	28.623.202,62	6,81%	2,85%	3,58%	do IMA-B	3.015.315.795	0,95%	6,81%		60%		35%		15%		20%	
Fundos de Índice ETF Renda Fixa em Indicadores de Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso III, Alínea B														Renda Fixa		0%		60%		0%		15%
Fundos de Renda Fixa Geral - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "A"						35.580.956,31		8,47%														
Santander FFPREV-491-9		FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-46		D=0	D=0	150.446,25	0,04%	0,46%	do CDI		4.521.307.116	0,00%										
Bradesco FFINPREV		Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25		D=0	D=1	2.536.746,62	0,60%	2,90%	do IMA-B		1.765.107.201	0,14%										
Bradesco FFINPREV		Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04		D=0	D=1	16.730.347,94	3,98%	1,76%	do IMA-B5		798.353.352	2,10%									Artigo 7º, Inciso IV "A"	
ITAÚ FFINPREV		Insttit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49		D=0	D=1	9.932.559,22	2,36%	0,78%	IPCA		5.159.078.115	0,19%										
ICATU FFINPREV		Icatu Vang Infl Curta FI RF 10.922.432/0001-03		D=0	D=1	6.230.856,28	1,48%	1,74%	do IMA-B5		517.681.504	1,20%										
Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Quaisquer Indicadores - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"														Renda Fixa		0%		40%		0%		15%
Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"														Renda Fixa		0%		20%		0%		15%
Certificados de Depósitos Bancários - CDB (limitado ao FGC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"														Renda Fixa		0%		15%		0%		15%
Poupança (limitado ao FGC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B"														Renda Fixa		0%		15%		0%		15%
FIDC Cotas Sênior - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A"														Renda Fixa		0%		5%		2%		5%
Fundos Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B"														Renda Fixa		0%		5%		0%		5%
Fundos de Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C"														Renda Fixa		0%		5%		0%		5%
INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS																						
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"								0,00%								0%		30%		15%		15%
Fundos ETF Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"								0,00%								0%		30%		0%		15%
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "A"						61.378.650,39		14,61%								82,27%						
ITAÚ FFINPREV		Insttit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07		D=21	D=24	19.226.239,02	4,58%	-0,48%	do IBOV		1.948.913.318	0,99%										
AZQUEST FFINPREV		FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72		D=27	D=28	10.430.503,09	2,48%	0,76%	do SMLL		1.262.371.454	0,8%										
AZQUEST FFINPREV		FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89		D=1	D=4	8.176.800,35	1,95%	1,94%	do IBOV		907.548.514	0,9%										
XP Investimentos FFPREV		XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12		D=1	D=4	6.658.958,28	1,59%	1,92%	do IDIV		341.556.070	1,95%										
CEF/Vinci Partner's FFPREV		FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15		D=30	D=33	3.483.044,69	1,01%	1,05%	IDIV		707.345.832	0,49%										
OCCAM FFPREV		OCCAM FIC FIA CNPJ 11.628.883/0001-03		D=1	D=18	6.287.837,21		3,32%	do IBOV		387.988.728	1,62%										
ICATU FFINPREV		Icatu Vang Dividendos FIA 08.279.304/0001-41		D=1	D=5	7.115.267,75	1,69%	2,64%	do IDIV	1,98%	1.581.305.324	0,45%										
Fundo ETF Índices em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"														Renda Variável		0%		20%		0%		15%
Fundos Multimercados - Aberto (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso III						8.489.126,43																
Mongeral Aegon FFINPREV		Mongeral Aegon FIM CNPJ 14.115.116/000180		D=1	D=1	2.519.462,49	0,60%	0,52%	CDI		156.498.479	1,61%										
CEFederal FFINPREV		Cap Prot Bolsa II Multim CNPJ 22.790.987/0001-28		D=0	D=21	2.000.867,50	0,58%	0,07%	CDI		99.823.069	2,00%	2,04%		10%		10%		5%		20%	
Western Asset FFINPREV		WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48		D=0	D=1	3.968.796,44	0,94%	2,21%	do CDI		741.480.995	0,54%										
Fundo de Participações - FIP (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"						4.588.398,25		1,09%														
Vinci Cap Partners FFPREV		FIP Multiestratégia II CNPJ 30.507.217/0001-53		Fechado	Fechado	589.805,17	0,14%	-1,07%	IPCA		22.840.205	2,58%	1,09%		5%		5%		5%		20%	
Kinea IV Feeder FFPREV		FIP CNPJ 27.782.774/0001-78		Fechado	Fechado	3.998.593,08	0,95%	-0,46%	IPCA		106.295.933	3,76%										
Fundo Imobiliário FI - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"								0,00%						Imobiliário		0,00%		5%		3%		5%
Fundo de Ações - Mercado de Acesso (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C"														Renda Variável		0%		5%		0%		5%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR																						
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso I														Exterior		0%		10%		0%		15%
Investimento no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso II														Exterior		0%		10%		0%		15%
Fundo de Ações - BDR-Nível 1 (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso III														Exterior		0%		10%		0%		15%
Disponibilidade de Caixa						0,00		0,00%														1%
Disponibilidade em Caixa FFPREV(Santander)								0,00%														
Disponibilidade em Caixa FFPREV( CEF + Santander + Itaú)								0,00%						Disponibilidade		0,00%						
<b>TOTAL DE ATIVOS</b>						<b>420.004.895,43</b>		<b>100,00%</b>								<b>100,02%</b>		<b>100,0%</b>				
Meta Atuarial(INPC (-)J0,05 + 0,486755)				0,44%		IBOVESPA		3,57%		IFIX		1,04%		IRF-M		1,44%		FFPREV - Ano				14,33%

Rentabilidade no mês SBCPREV FFPREV	1,91%	IBRX	3,21%	IMA-B	2,86%	IRFM 1	0,64%	Meta Atuarial - Ano	7,22%
INPC	-0,05%	IBRX50	3,69%	IMA-G	1,46%	IRFM 1+	1,87%	FFPREV - 12 meses	22,36%
CDI	0,46%	SMLL	2,08%	IMA-B 5	1,74%	IMA-C	1,74%	Meta Atuarial - 12 Meses	9,07%
IPCA	-0,04%	IDIV	1,89%	IMA-B 5+	3,73%	IMA-S	0,47%		420.004.895,43
									1.003.450.543,80
									1.423.455.439,23

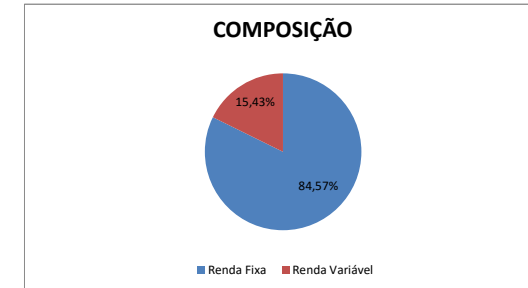
Total FFIN2 + FFINPrev **1.423.455.439,23**

Renda Fixa	rentabilidade no mês	2,09%	345.548.720,36	82,27%	Renda Fixa	933.034.014,82	82,84%
Renda Variável	rentabilidade no mês	1,06%	74.456.175,07	17,73%	Renda Variável	193.252.694,18	17,16%
Disponibilidade Caixa		1,91%	420.004.895,43	100,00%	Disponibilidade de Caixa	7.943,81	0,00%
					Total Geral	1.126.294.652,81	100,00%

Consolidado

FFPREV	Setembro 2019	420.004.895,43	100,00%	100,00%
<b>RENDA FIXA</b>		<b>345.548.720,36</b>	<b>82,27%</b>	<b>100,00%</b>
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)		52.048.956,52	12,39%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)		229.295.604,91	54,59%	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)		28.623.202,62	6,81%	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)		35.580.956,31	8,47%	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)		0,00	0,00%	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%
<b>RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS</b>		<b>74.456.175,07</b>	<b>17,73%</b>	<b>50,00%</b>
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)		61.378.650,39	14,61%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)		0,00	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)		8.489.126,43	2,02%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)		4.588.398,25	1,09%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliário)		0,00	0,00%	5,00%
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - FAções - Mercado de Acesso		0,00	0,00%	5,00%
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>
Art. 9º-A, Inciso I - Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa		0,00	0,00%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso II - Investimento no Exterior		0,00	0,00%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso III - Fundo de Ações - BDR-Nível 1		0,00	0,00%	10,00%
Disponibilidade de Caixa		0,00	0,00%	0,00%

Lim Resol



CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA			
Títulos Públicos	52.048.956,52	12,39%	
CEFederal	124.382.805,10	29,61%	
Santander	85.698.109,97	20,40%	
Banco do Brasil	30.084.961,09	7,16%	
Itaú	29.158.798,24	6,94%	
Bradesco	19.267.094,56	4,59%	
AZQuest	18.607.303,44	4,43%	
Western	9.717.249,63	2,31%	
Sul América	14.155.791,93	3,37%	
ARX Investimentos	0,00	0,00%	
Safra	0,00	0,00%	
Kinea/Itaú	3.998.593,08	0,95%	
Icatu Vanguard	13.346.124,03	3,18%	
RBCapital	0,00	0,00%	
Occan	6.287.837,21		
Vinci Partner's/CEF	3.483.044,69	0,83%	
Ourinvest	0,00	0,00%	
Mongeral Aegon	2.519.462,49	0,60%	
Reag	0,00	0,00%	
XP Investimentos	6.658.958,28	1,59%	
BTG	0,00	0,00%	
BRZ	0,00	0,00%	
TrendBank	0,00	0,00%	
BVA	0,00	0,00%	
Vinci Partner's	589.805,17	0,14%	
Saldo Caixa	0,00	0,00%	
<b>TOTAL</b>	<b>420.004.895,43</b>	<b>98,50%</b>	

RENDA FIXA  
% do total

% da Rfixa

Títulos Públicos	12,39%	52.048.956,52	15,06%
IMA-B	16,42%	68.953.664,54	19,95%
IMA-B5	33,19%	139.420.231,86	40,35%
IMA-B5 - ATIVO	1,37%	5.748.453,19	1,66%
Alocação Dinâmica	2,36%	9.932.559,22	2,87%
IRF-M	16,50%	69.294.408,78	20,05%
DI + Outros R Fixa	0,04%	150.446,25	0,04%
FIDC	0,00%	0,00	0,00%
	<b>82,27%</b>	<b>345.548.720,36</b>	<b>100,00%</b>

**RENDA VARIÁVEL**

	<b>% do total</b>		<b>% da Rvariável</b>
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	8,02%	33.690.876,58	45,25%
<b>Dividendos</b> Ações Livre Geral 8-II-a	4,11%	17.257.270,72	23,18%
<b>Small Caps</b> Ações Livre Geral 8-II-a	2,48%	10.430.503,09	14,01%
ETF Ações Livre Geral 8-II-b	0,00%	0,00	0,00%
<b>Multimercados</b> 8-III	2,02%	8.489.126,43	11,40%
FIP Fechado 8-IV-a	1,09%	4.588.398,25	6,16%
Imobiliário 8-IV-b	0,00%	-	0,00%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c	0,00%	-	0,00%
<b>Total</b>	<b>17,73%</b>	<b>74.456.175,07</b>	<b>100,00%</b>

**EXTERIOR**

Renda Fixa -Dívida Externa - 9ªA, inciso I	0,00%	1,00	1
Investimento Exterior 9ªA, inciso II	0,00%	-	0
Ações BDR-Nível 1 - 9ªA, inciso III	0,00%	-	0
	0,00%		0
<b>Total</b>	<b>0,00%</b>	<b>1,00</b>	<b>1</b>

Disponibilidade Financeira -

**TOTAL 420.004.895,43**