

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 31/10/2019

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Resgate	Resgate	VLR. APLICADO		Rentabilidade			Limites		SEGMENTO / CATEGORIA	Limites					NORMA	
				Nominal	% Patr	Mês	Exercício	% Benchmark ano	PL do Fundo	%		Aplicado RPPS	RESOL 3.922	Politic Invest	%PL do Fundo	Max 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				54.148.849,64		12,42%												
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 2.000			7.614.909,17	1,75%	1,09%	IPCA + 6,35 % aa	4,2129%		Renfda Fixa TP		12,42%	100%	40%	0%	0%	Artigo 7º, inciso I, Alínea "A"	
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400			13.599.648,62	3,12%	0,94%	IPCA + 6,248 % aa											
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000			18.296.828,81	4,20%	0,57%	IPCA + 5,688 % aa											
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200			14.637.463,04	3,36%	0,57%	IPCA + 7,484 % aa											
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham 100% TP do TN- Art. 7º, Inciso I, Alínea B				233.729.942,92		53,62%												
Santander FFPREV	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ.- 13.455.117/0001/01	D+0	D+1	50.826.700,93	11,66%	1,63%	do IMA-B	1.319.606.230	3,85%	Renda Fixa TP								
Santander FFINPREV	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D+0	D+1	12.100.578,10	2,78%	1,69%	do IMA-B	3.018.842.044	0,40%									
Santander FFPREV	FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D+0	D+1	24.427.292,24	5,60%	3,34%	do IMA-B	1.516.704.217	1,61%									
Bco do Brasil FFINPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D+0	D+1	17.794.611,90	4,08%	1,68%	do IRF-M	5.394.586.843	0,33%	Renda Fixa TP		53,62%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, inciso I, Alínea "B"	
Bco do Brasil FFINPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D+0	D+1	12.791.454,05	2,93%	1,64%	do IMA-B5	4.676.887.166	0,27%									
CEF FFINPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D+0	D+0	40.570.597,93	9,31%	1,69%	do IMA-B5	12.895.848.435	0,31%									
CEF FFINPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10	D+0	D+0	54.746.894,80	12,56%	1,64%	do IMA-B5	10.184.716.977	0,54%									
Sul América - FFINPREV	INFLATIE FI RF LP 09.326.708/0001-01	D+1	D+2	14.582.724,87	3,35%	3,02%	do IMA-B	1.985.651.255	0,73%									
Western Asset FFINPREV	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D+0	D+1	5.889.088,10	1,35%	2,45%	do IMA-B5	517.818.804	1,14%									
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C										Renda Fixa TP		0%	100%	0%	15%	20%	Art. 7º, inciso I, Alínea C	
Operações Compromissadas Lastreadas 100%em TP do TN - Art. 7º, Inciso II										Renda Fixa TP		0%	5%	0%	15%	20%	Art. 7º, inciso II	
Fundos "Referenciados" em Indicadores RfIXa (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso III, Alínea "A"				29.580.657,75		6,79%				Renda Fixa Referenciado								
CEF FFINPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D+0	D+0	29.580.657,75	6,79%	3,35%	3,58%	do IMA-B	3.133.522.204	0,94%	Renda Fixa Referenciado	6,79%	60%	35%	15%	20%	Art. 7º, inciso III, Alínea "A" (15% PL do FI)	
Fundos de Índice ETF Renda Fixa em Indicadores de Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso III, Alínea B										Renda Fixa		0%	60%	0%	15%	20%	Art. 7º, inciso III, Alínea "B"	
Fundos de Renda Fixa Geral - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "A"				36.058.831,10		8,27%												
Santander FFPREV-491-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-46	D+0	D+0	104.510,95	0,02%	0,42%	do CDI	4.397.786.267	0,00%	Renda Fixa								
Bradesco FFINPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	D+0	D+1	2.624.962,96	0,60%	3,48%	do IMA-B	1.872.479.361	0,14%	Renda Fixa		8,27%	40%	25%	15%	20%	Artigo 7º, inciso IV "A"	
Bradesco FFINPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D+0	D+1	17.012.595,05	3,90%	1,69%	do IMA-B5	831.247.299	2,05%									
ITAÚ FFINPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D+0	D+1	9.981.863,86	2,29%	0,50%	IPCA	5.147.659.269	0,19%									
ICATU FFINPREV	Icatu Vang Infl Curta FI RF 10.922.432/0001-03	D+0	D+1	6.334.898,28	1,45%	1,67%	do IMA-B5	567.112.774	1,12%									
Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Quaisquer Indicadores - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"										Renda Fixa		0%	40%	0%	15%	20%	Art. 7º, inciso IV, Alínea "B"	
Letras Imobiliárias Garantida - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"										Renda Fixa		0%	20%	0%	15%	20%	Art. 7º, inciso V, Alínea "B"	
Certificados de Depósitos Bancários - CDB (limitado ao FGC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"										Renda Fixa		0%	15%	0%	15%	20%	Art. 7º, inciso VI, Alínea "A"	
Poupança (limitado ao FGC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B"										Renda Fixa		0%	15%	0%	15%	20%	Art. 7º, inciso VI, Alínea "B"	
FIDC Cotas Sênior - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A"										Renda Fixa		0%	5%	2%	5%	20%	Art. 7º, inciso VII, Alínea "A"	
Fundos Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B"										Renda Fixa		0%	5%	0%	5%	20%	Art. 7º, inciso VII, Alínea "B"	
Fundos de Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C"										Renda Fixa		0%	5%	0%	5%	20%	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%	30%	15%	20%	20%	Artigo 8º, inciso I, Alínea "A"	
Fundos ETF Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"						0,00%						0%	30%	0%	15%	20%	Artigo 8º, inciso I, Alínea "B"	
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "A"				69.207.642,83		15,88%						81,10%						
ITAÚ FFINPREV	Instit Ações Phoenix FIA - 23.731.629/0001-07	D+21	D+24	19.399.003,72	4,45%	0,90%	do IBOV	2.102.836.709	0,92%	Renda Variável		15,88%	20%	10%	15%	20%	Artigo 8º, inciso II, Alínea "A"	
AZQUEST FFINPREV	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	10.808.968,95	2,48%	3,63%	do SMLL	1.301.378.669	0,8%									
AZQUEST FFINPREV	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	8.362.559,37	1,92%	2,27%	do IBOV	884.029.102	0,9%									
XP Investimentos FFPREV	XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12	D+1	D+4	6.966.271,55	1,60%	4,62%	do IDIV	355.339.489	1,96%									
CEF/Vinci Partner's FFPREV	FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15	D+30	D+33	3.603.436,44	1,02%	3,46%	IDIV	749.627.403	0,48%									
OCCAN FFPREV	OCCAN FIC FIA CNPJ 11.628.883/0001-03	D+1	D+18	12.819.665,41	3,63%	0,94%	do IBOV	441.379.292	2,90%									
ICATU FFINPREV	Icatu Vang Dividendos FIA 08.279.304/0001-41	D+1	D+5	7.247.737,39	1,66%	1,86%	1,98%	do IDIV	1.993.814.995	0,36%	Renda Variável		0%	20%	0%	15%	20%	Artigo 8º, inciso II, Alínea "B"
Fundo ETF Índices em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"																		
Fundos Multimercados - Aberto (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso III				8.600.655,97														
Mongeral Aegon FFINPREV	Mongeral Aegon FIM CNPJ 14.115.116/000180	D+1	D+1	2.534.750,76	0,58%	0,61%	do CDI	156.650.329	1,62%	Renda variável		1,98%	10%	10%	5%	20%	Artigo 8º, inciso III	
CEFederal FFINPREV	Cap Prot Bolsa II Multim CNPJ 22.790.987/0001-28	D+0	D+821	2.012.516,72	0,57%	0,58%	do CDI	100.404.247	2,00%									
Western Asset FFINPREV	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	4.053.388,49	0,93%	2,13%	do CDI	724.008.625	0,56%									
Fundo de Participações - FIP (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"				4.559.143,76		1,05%												
Vinci Cap Partners III FFPREV	FIP Multiesratégia II CNPJ 30.507.217/0001-53	Fechado	Fechado	582.739,86	0,13%	-1,20%	IPCA	22.566.601	2,58%	FIP Participações		1,05%	5%	5%	5%	20%	Artigo 8º, inciso IV, Alínea "A"	
Kinea IV Feeder FFPREV	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	3.976.403,90	0,91%	-0,55%	IPCA	106.403.378	3,74%									
Fundo Imobiliário FI - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"						0,00%				Imobiliário		0,00%	5%	3%	5%	20%	Artigo 8º, inciso IV, Alínea "B"	
Fundo de Ações - Mercado de Acesso (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C"										Renda Variável		0%	5%	0%	5%	20%	Artigo 8º, inciso IV, Alínea "C"	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR																		
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso I										Exterior		0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso I	
Investimento no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso II										Exterior		0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso II	
Fundo de Ações - BDR Nível 1 (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso III										Exterior		0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso III	
Disponibilidade de Caixa				0,00		0,00%						18,90%		1%				

BRZ		0,00	0,00%
TrendBank		0,00	0,00%
BVA		0,00	0,00%
Vinci Partner's		582.739,86	0,13%
Saldo Caixa		0,00	0,00%
TOTAL		435.885.723,97	97,06%

RENTA FIXA

	% do total		% da Rfixa
Títulos Públicos	12,42%	54.148.849,64	15,32%
IMA-B	16,34%	71.215.637,82	20,14%
IMA-BS	32,51%	141.712.543,11	40,09%
IMA-BS - ATIVO	1,35%	5.889.088,10	1,67%
Alocação Dinâmica	2,29%	9.981.863,86	2,82%
IRF-M	16,17%	70.465.787,93	19,93%
DI + Outros R Fixa	0,02%	104.510,95	0,03%
FIDC	0,00%	0,00	0,00%
	81,10%	353.518.281,41	100,00%

RENTA VARIÁVEL

	% do total		% da Rvariável
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	9,31%	40.581.228,50	49,27%
Dividendos Ações Livre Geral 8-II-a	4,09%	17.817.445,38	21,63%
Small Caps Ações Livre Geral 8-II-a	2,48%	10.808.968,95	13,12%
ETF Ações Livre Geral 8-II-b	0,00%	0,00	0,00%
Multimercados 8-III	1,97%	8.600.655,97	10,44%
FIP Fechado 8-IV-a	1,05%	4.559.143,76	5,54%
Imobiliário 8-IV-b	0,00%	-	0,00%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c	0,00%	-	0,00%
Total	18,90%	82.367.442,56	100,00%

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
Total	0,00%	1,00	1

Disponibilidade Financeira

-

TOTAL

435.885.723,97