

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 30/06/2020

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Resgate	Resgate	VLR. APLICADO	Rentabilidade					SEGMENTO / CATEGORIA	Limites					NORMA					
					Nominal	% Patr do RPPS	Mês	Ano	12 Meses		24 Meses	% Benchmark ano	PL do Fundo	% s/PL do Fundo	Aplicado RPPS		RESOL 3.922 + Nivel 1 Pró Gestão	Politic Invest	%PL do Fundo	Máx PL do RPPS por Fundo	
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																					
Títulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea A				51.078.278,71	10,28%											61,81%					
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 2.000			7.583.906,35	1,53%	2,22%					IPCA + 6,35 % aa	2,2217									
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400			13.660.276,16	2,75%	2,22%					IPCA + 6,248 % aa										
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000			16.574.497,89	3,34%	2,22%					IPCA + 5,688 % aa										
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200			13.259.598,31	2,67%	2,22%					IPCA + 7,484 % aa										
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B				203.037.008,87	40,87%																
Santander FFPREV	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ.- 13.455.117/0001/01	D+0	D+1	44.281.437,66	8,91%	1,08%					do IMA-B	1.060.557.880	4,18%								
Santander FFPREV	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D+0	D+1	12.666.439,98	2,55%	0,76%					do IMA-B	3.132.351.815	0,40%								
Santander FFPREV	FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D+0	D+1	23.800.516,98	4,79%	2,00%					do IMA-B	1.214.596.338	1,96%								
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D+0	D+1	12.193.484,83	2,45%	0,77%					do IRF-M	5.220.862.295	0,23%								
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D+0	D+1	6.016.133,96	1,21%	1,08%					do IMA-B5	4.025.627.854	0,15%								
CEF FFPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D+0	D+0	43.454.636,82	8,75%	0,77%					do IMA-B5	17.164.831.994	0,25%								
CEF FFPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10	D+0	D+0	40.240.067,15	8,10%	1,10%					do IMA-B5	8.746.335.682	0,46%								
Sul América - FFPREV	INFLATIE FI RF LP 09.326.708/0001-01	D+1	D+2	14.188.374,33	2,86%	2,14%					do IMA-B	1.301.336.044	1,09%								
Western Asset FFPREV	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D+0	D+1	6.195.917,16	1,25%	1,41%					do IMA-B5	608.337.848	1,02%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C																					
Operações Compromissadas Lastreadas 100%em TP do TN - Art. 7º, Inciso II																					
Fundos "Referenciados" em Indicadores RFixa (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso III, Alínea "A"				14.133.988,56	2,85%																
CEF FFPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D+0	D+0	14.133.988,56	2,85%	2,03%				3,58%	do IMA-B	2.894.677.261	0,49%								
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"				38.773.197,45	7,81%																
Santander FFPREV-491-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D+0	D+0	184.933,56	0,04%	0,04%					do CDI	1.849.278.571	0,01%								
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	D+0	D+1	2.564.794,29	0,52%	2,09%					do IMA-B	1.949.868.393	0,13%								
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D+0	D+1	12.499.467,64	2,52%	1,09%					do IMA-B5	863.646.242	1,45%								
AZQUEST	Yield FIQRF LP CNPJ 16.599.968/0001-16	D+0	D+1	6.661.299,44	1,34%	0,34%					do CDI	286.923.307	2,32%								
ITAÚ FFPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D+0	D+1	10.278.982,20	2,07%	0,44%					IPCA	5.170.951.886	0,20%								
ICATU FFPREV	Icatu Vang Infl Curta FI RF 10.922.432/0001-03	D+0	D+1	6.583.720,32	1,33%	1,08%					do IMA-B5	560.771.878	1,17%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Quaisquer Indicadores - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"																					
Letras Imobiliárias Garantida - 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"																					
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																					
												27,16%									
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"					0,00%											0,00%	35%	15%	15%	20%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A"
Fundos ETF Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"					0,00%											0,00%	35%	0%	15%	20%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea "B"
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "A"				111.016.357,50	22,35%																
ITAÚ FFPREV	Instit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07	D+21	D+24	15.741.982,39	3,17%	12,10%					do IBOV	1.785.775.188	0,88%								
ITAÚ FFPREV	Instit Ações Dunamis FICFIA -24.571.992/0001-75	D+22	D+23	12.520.560,54	9,28%	9,28%					do IBOV	3.271.694.900	0,38%								
AZQUEST FFPREV	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	9.948.539,27	2,00%	8,63%					do SMLL	1.154.678.354	0,9%								
AZQUEST FFPREV	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	7.349.489,86	1,48%	9,88%					do IBOV	806.010.588	0,9%								
AZQUEST FFPREV	SMALL MID CAPS RPPS FIC FIA - 34.791.108/0001-61	D+1	D+29	4.658.423,84	0,94%	8,54%					do IBOV	254.015.432.15	1,8%								
XP Investimentos FFPREV	XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12	D+1	D+4	5.842.813,26	1,18%	6,43%					do IDIV	268.815.790	2,17%								
CEF/Vinci Partner's FFPREV	FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15	D+30	D+33	3.271.185,50	1,07%	4,58%					IDIV	799.344.502	0,41%								
CEFederal FFPREV	FIC ACOES VALOR RPPS CNPJ: 14.507.699/0001-95	D+21	D+23	18.336.731,21	5,97%	9,33%					IDIV	529.679.544	3,46%								
OCCAN FFPREV	OCCAM FIC FIA CNPJ 11.628.883/0001-03	D+1	D+18	11.799.465,50	3,84%	8,97%					do IBOV	682.416.337	1,73%								
PERFIN FFPREV	Perfin Instituc. FIC FIA CNPJ 10.608.762/0001-29	D+30	D+33	862.864,10	0,28%	8,04%					do IBOV	377.481.508	0,23%								
MOAT FFPREV	Moat Capital Advisory FIC FIA CNPJ: 35.354.967/0001-56	D+15	D+17	12.197.225,41	3,97%	12,73%					do IBOV	1.036.660.824	1,18%								
BTG Pactual FFPREV	ABSOLUTO INS FIQ FIA CNPJ: 11.977.794/0001-64	D+1	D+32	2.229.183,01	0,73%	1,32%					do IBOV	2.091.503.187,63	0,11%								
ICATU FFPREV	Icatu Vang Dividendos FIA 08.279.304/0001-41	D+1	D+5	6.257.893,61	1,26%	7,89%				1,98%	do IDIV	1.556.319.793	0,40%								
Fundo ETF Índices em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"																					
Fundos Multimercados - Aberto (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso III				14.692.291,46	2,96%																
Mongeral Aegon FFPREV	Mongeral Aegon FIM CNPJ 14.115.116/000180	D+1	D+1	2.558.968,91	0,52%	0,48%					CDI	121.053.956	2,11%								
CEFederal FFPREV	Cap Prot Bolsa II Multim CNPJ 22.790.987/0001-28	D+0	D+821	2.094.734,10	0,68%	0,77%					CDI	104.157.636	2,01%								
Western Asset FFPREV	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	10.038.588,45	2,02%	0,85%					do CDI	896.638.683	1,12%								

Fundo de Participações - FIP - (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"				9.211.929,21	1,85%															
Vinci Cap Partners III FFPREV	FIP Multiesratégia II CNPJ 30.507.217/0001-53	Fechado	Fechado	592.510,11	0,12%	-1,19%				IPCA	22.944.954	2,58%								
Kinea IV Feeder FFPREV	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	8.619.419,10	1,74%	8,37%		1,3334341	171.836.682,00	IPCA	229.132.884	3,76%	FI Participações	1,85%	5%	4%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A"	
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	0,00%	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				54.788.933,53	11,03%								Exterior	0,00%	10%	10%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso I	
Investimento no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso II				43.063.250,27																
SANTANDER FFPREV	GLOBAL EQUITIES IE CNPJ: 17.804.792/0001-50	D+1	D+8	6.711.632,65	1,35%	4,43%				MCSI World	379.342.108,47	1,77%	MM Inv Ext				5%			
BB do Brasil/JP Morgan FFPREV	BB MM GLOBAL SELECT - 17.413.636/0001-68	D+1	D+5	7.419.242,24	1,49%	3,55%				MCSI World	884.737.429	0,8%	MM Inv Ext				5%			
XP Inv/Morgan Stanley	MS GLOBAL OPP FIC FIA IE - CNPJ 33.913.562/0001-85	D+1	D+5	11.953.020,24	3,89%	7,69%				MCSI World	306.230.784	3,90%	Ações Inv Ext	8,67%	10%	10%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso II	
Western Asset FFPREV	LEGG MASON - CNPJ: 28.320.600/0001-56	D+1	D+5	5.493.232,42	1,11%	3,00%				Russel 1000	59.441.601,02	9,24%	Ações Inv Ext				15%			
Western Asset FFPREV	MACRO DOLAR MM IE - CNPJ: 23.872.712/0001-04	D+1	D+5	6.441.819,22	1,30%	2,38%				DOL-D2	78.909.151,97	8,16%	MM Inv Ext				5%			
Western Asset FFPREV	MACRO FIM IE - CNPJ: 22.282.992/0001-20	D+1	D+5	5.044.303,50	1,02%	1,53%				DOL-D3	910.225.679,54	0,55%	MM Inv Ext				5%			
Fundo de Ações - BDR-Nível 1 (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso III				11.725.683,26																
Western Asset FFPREV	AÇÕES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D+1	D+5	11.725.683,26	2,36%	4,31%				NA	921.500.996,38	1,27%	Ações Inv Ext	2,36%	10%	10%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso III	
Disponibilidade de Caixa				0,00	0,00%									Disponibilidade	0,00%					
Disponibilidade em Caixa FFPREV(Santander)						0,00%														
Disponibilidade em Caixa FFPREV(CEF + Santander + Itaú)						0,00														
TOTAL DE ATIVOS				496.731.985,29	100,00%															

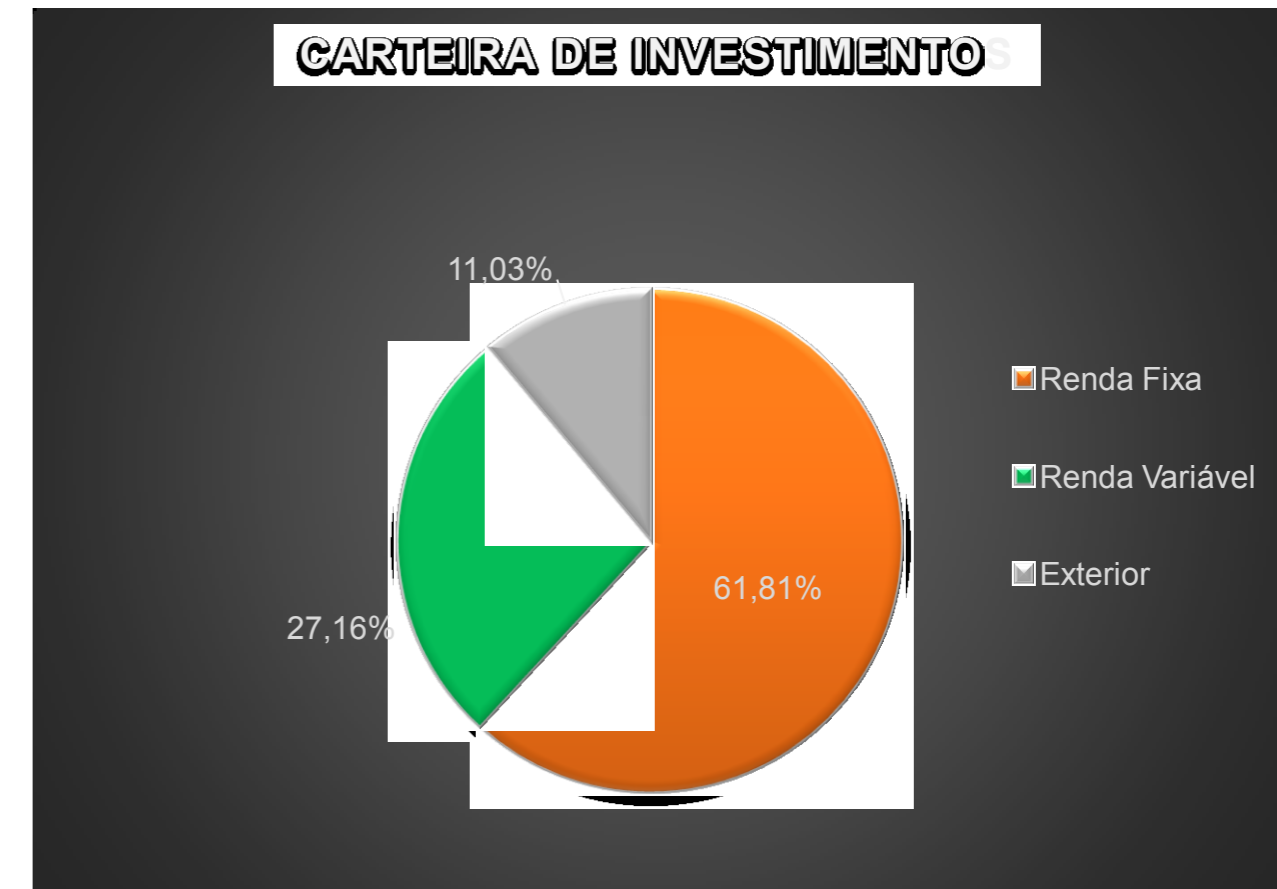
Meta Atuarial(INPC+ 4,00%aa)= (+) 0,30 + 0,327374)	0,63%	IBOVESPA	8,76%	IFIX	2,08%	IRF-M	1,42%	FFPREV - Ano	-1,55%
Rentabilidade no mês SBCPREV FFPREV	3,44%	IBrX	9,10%	IMA-B	1,52%	IRFM 1	0,42%	Meta Atuarial - Ano	2,36%
INPC	0,30%	IBrX50	9,10%	IMA-G	1,02%	IRFM 1+	1,92%	FFPREV - 12 meses	6,86%
CDI	0,21%	SMLL	5,07%	IMA-B 5	2,13%	IMA-C	2,63%	Meta Atuarial - 12 Meses	7,49%
IPCA	0,26%	IDIV	5,00%	IMA-B 5+	1,02%	IMA-S	0,24%		
Total FFIN2 + FFINPrev									496.731.985,29
									877.646.078,04
									1.374.378.063,33

CARTEIRA DE INVESTIMENTO

Renda Fixa	rentabilidade no mês	1,34%		307.022.473,59	61,81%
Renda Variável	rentabilidade no mês	8,28%	3,71	134.920.578,17	27,16%
Exterior	rentabilidade no mês	4,31%		54.788.933,53	11,03%
Disponibilidade Caixa		3,44%	3,19	0,00	0,00%
				496.731.985,29	100,00%

Consolidado	
Renda Fixa	994.127.457,39 66,83%
Renda Variável	430.696.127,83 28,95%
Exterior	59.740.896,63 4,02%
Disponibilidade de Caixa	2.958.034,11 0,20%
Total Geral	1.487.522.515,96 100,00%

FFPREV	Junho 2020	496.731.985,29	100,00%	100,00%
RENDA FIXA				
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)				
		51.078.278,71	10,28%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)				
		203.037.008,87	40,87%	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)				
		14.133.988,56	2,85%	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)				
		38.773.197,45	7,81%	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%
RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS				
		134.920.578,17	27,16%	50,00%
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)				
		111.016.357,50	22,35%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)				
		0,00	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)				
		14.692.291,46	2,96%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)				
		9.211.929,21	1,85%	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%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR				
		54.788.933,53	11,03%	10,00%
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				
		43.063.250,27	8,67%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso III - Fundo de Ações - BDR-Nível 1				
		11.725.683,26	2,36%	10,00%
Disponibilidade de Caixa				
		0,00	0,00%	0,00%



CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA			
Titulos Públicos	51.078.278,71	10,28%	
CEFederal	118.260.157,84	23,81%	
Santander	87.644.960,83	17,64%	
Banco do Brasil	25.628.861,03	5,16%	
Itaú	38.541.525,13	7,76%	
Bradesco	15.064.261,93	3,03%	
AZQuest	28.617.752,41	5,76%	
Western	44.939.544,01	9,05%	
Sul América	14.188.374,33	2,86%	
ARX Investimentos	0,00	0,00%	
Safra	0,00	0,00%	
Kinea/Itau	8.619.419,10	1,74%	
Icatu Vanguard	12.841.613,93	2,59%	
RBCapital	0,00	0,00%	
Occan	11.799.465,50	2,38%	
Vinci Partner's/CEF	3.271.185,50	0,66%	
Ourinvest	0,00	0,00%	
Mongeral Aegon	2.558.968,91	0,52%	
Reag	0,00	0,00%	
XP Investimentos	17.795.833,50	3,58%	
BTG Pactual	2.229.183,01	0,45%	
BRZ	0,00	0,00%	
TrendBank	0,00	0,00%	
BVA	0,00	0,00%	
Vinci Partner's	592.510,11	0,12%	
Moat	12.197.225,41	2,46%	
Perfin	862.864,10	0,17%	
Saldo Caixa	0,00	0,00%	
TOTAL	496.731.985,29	100,00%	

RENDA FIXA			
	% do total		% da Rfixa
Titulos Públicos	10,28%	51.078.278,71	16,64%
IMA-B	11,01%	54.687.674,16	17,81%
IMA-B5	22,07%	109.620.826,73	35,70%
IMA-B5 - ATIVO	1,25%	6.195.917,16	2,02%
Alocação Dinâmica	2,07%	10.278.982,20	3,35%
IRF-M	13,75%	68.314.561,63	22,25%
DI + Outros R Fixa	1,38%	6.846.233,00	2,23%
FIDC	0,00%	0,00	0,00%
	61,81%	307.022.473,59	100,00%

RENDA 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	12,62%	62.700.770,81	46,47%
Dividendos Ações Livre Geral 8-II-a	7,72%	38.367.047,42	28,44%
Small Caps Ações Livre Geral 8-II-a	2,00%	9.948.539,27	7,37%
ETF Ações Livre Geral 8-II-b	0,00%	0,00	0,00%
Multimercados 8-III	2,96%	14.692.291,46	10,89%
FIP Fechado 8-IV-a	1,85%	9.211.929,21	6,83%
FImobiliário 8-IV-b	0,00%	-	0,00%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c	0,00%	-	0,00%
Total	27,16%	134.920.578,17	100,00%

EXTERIOR			
Renda Fixa - Dívida Externa - 9ªA, inciso I	0,00%	1,00	1,8E-08
Investimento Exterior 9ªA, inciso II	8,67%	43.063.250,27	0,78598
Ações BDR-Nível 1 - 9ªA, inciso III	2,36%	11.725.683,26	0,21402
	0,00%		0
Total	11,03%	54.788.934,53	1

Disponibilidade Financeira	-		
TOTAL	496.731.986,29		