

SBCPREV - CONSOLIDADO - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 30/09/2020																
INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Resgate	Resgate	VLR. APLICADO		entabilidade		Limites		SEGMENTO / CATEG	Limite	RESOL 3.922 + Nível 1 Pró Gestão	Política Invest	%PL do Fundo	Máx PL do RPPS por Fundo	NORMA
				Nominal	% Patr do RPPS	Mês	Bechmark	PL do Fundo	% do PL do Fundo							
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																
Títulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea A				222.710.941,43	16,97%						52,11%					
CEFederal (custodiante)	NTN-B (ipca) venc 15/05/2021 - 3.450			12.312.244,23	0,94%	-1,86%	IPCA + 6,35 % aa									
CEFederal (custodiante)	NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 7.600			29.260.206,28	2,23%	-1,86%	IPCA + 6,45 % aa	-1,8577								
CEFederal (custodiante)	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 8.500			35.651.722,19	2,72%	-1,86%	IPCA + 7,484 % aa									
CEFederal (custodiante)	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.450			14.470.404,89	1,10%	-1,86%	IPCA + 6,23 % aa									
CEFederal (custodiante)	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 6.000			25.165.921,54	1,92%	-1,86%	IPCA + 6,49 % aa									
CEFederal (custodiante)	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 13.000			54.526.163,35	4,15%	-1,86%	IPCA + 5,688 % aa									
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000			16.777.281,03	1,28%	-1,86%	IPCA + 5,688 % aa									
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 2.000			7.700.054,28	0,59%	-1,86%	IPCA + 6,35 % aa									
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400			13.425.118,82	1,02%	-1,86%	IPCA + 6,248 % aa									
CEFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200			13.421.824,82	1,02%	-1,86%	IPCA + 7,484 % aa									
Fundos Referenciados Renda Fixa que contemham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B				371.620.915,58	28,31%											
Santander	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ. - 13.455.117/0001/01	D=0	D=1	39.968.143,27	3,04%	-0,15%	do IMA-B	1.117.588.180	3,58%							
Santander	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D=0	D=1	22.273.341,00	1,70%	-0,73%	do IMA-B	3.345.021.743	0,67%							
Santander	FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D=0	D=1	3.491.847,32	0,27%	-1,54%	do IMA-B	1.112.978.638	0,31%							
Santander FFPREV	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ. - 13.455.117/0001/01	D=0	D=1	44.825.156,97	3,41%	-0,15%	do IMA-B	1.117.588.180	4,01%							
Santander FFPREV	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D=0	D=1	13.804.123,17	1,05%	-0,73%	do IMA-B	3.345.021.743	0,41%							
Santander FFPREV	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 10.979.017/0001-96	D=0	D=1	-	0,00%	0,00%	do IMA-B	96.181.427	0,00%							
Santander FFPREV	FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D=0	D=1	24.010.486,34	1,83%	-1,54%	do IMA-B	1.112.978.638	2,16%							
Bco do Brasil	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D=0	D=1	17.367.804,01	1,32%	-0,66%	do IRF-M	4.983.832.925	0,35%							
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D=0	D=1	12.151.370,23	0,93%	-0,66%	do IRF-M	4.983.832.925	0,22%							
Bco do Brasil	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D=0	D=1	9.811.610,14	0,75%	-0,15%	do IMA-B5	4.406.252.864	0,22%							
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D=0	D=1	8.504.530,66	0,65%	-0,15%	do IMA-B5	4.406.252.864	0,19%							
Bco do Brasil	BB Previd RF ALOC ATIVA FIC FI - 25.078.994/0001-90	D=0	D=1	20.135.658,67	1,53%	-0,75%	do IMA-B5	10.452.752.169	0,19%							
Safra	IMA-B FIC FI - 10.787.822/0001-18	D=1	D=4	20.181.465,80	1,54%	-2,12%	do IMA-B	1.126.582.666	1,79%							
CEF	FI IMA-B5 RF Tit Públicos - 11.060.913/0001-10	D=0	D=0	14.182.422,19	1,08%	-0,16%	do IMA-B5	17.747.142.317	0,08%							
CEF	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D=0	D=0	8.596.543,74	0,65%	-0,61%	do IMA-B5	11.234.342.143	0,08%							
CEF FFPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D=0	D=0	40.937.214,77	3,12%	-0,61%	do IMA-B5	11.234.342.143	0,36%							
CEF FFPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10	D=0	D=0	41.058.555,70	3,13%	-0,16%	do IMA-B5	17.747.142.317	0,23%							
Sul América - FFPREV	INFLATIE FI RF LP 09.326.708/0001-01	D=1	D=2	14.339.954,65	1,09%	-1,27%	do IMA-B	1.340.579.688	1,07%							
Western Asset	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D=0	D=1	9.743.367,68	0,74%	-0,81%	do IMA-B5	717.075.038	1,36%							
Western Asset FFPREV	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D=0	D=1	6.237.319,27	0,48%	-0,81%	do IMA-B6	717.075.038	0,87%							
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contemham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C																
Operações Compromissadas Lastreadas 100%sem TP do TN - Art. 7º, Inciso II																
Fundos "Referenciados" em Indicadores Rfisa (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso III, Alínea "A"				16.637.718,46	1,27%											
CEF FFPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D=0	D=0	14.259.537,96	1,09%	-1,54%	do IMA-B	2.850.384.469	0,5%							
Mongeral Aegon FFPREV	Mongeral Aegon Infl IMA-B 14.115.118/0001-70	D=2	D=3	2.378.180,50	0,18%	-1,71%	do IMA-B	141.472.863								
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"				213.798.755,23	16,29%											
Santander FFIN1-478-8	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	-	0,00%	0,00%	do CDI	1.693.031.076	0,00%							
Santander FFIN1-480-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	-	0,00%	0,00%	do CDI	1.693.031.076	0,00%							
Santander FFIN2-479-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	9.916.307,21	0,76%	0,00%	do CDI	1.693.031.076	0,59%							
Santander FFIN1-493-3	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	-	0,00%	0,00%	do CDI	1.693.031.076	0,00%							
Santander FFPREV-491-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	-	0,00%	0,07%	do CDI	1.693.031.076	0,0%							
Bco do Brasil	BB Previd RF IMA-B - 07.861.554/0001-22	D=0	D=1	37.464.747,84	2,85%	-1,57%	do IMA-B	1.338.179.968	2,80%							
CEF	CAIXA FIC BRASIL GEST ESTR RF - 23.215.097/0001-55	D=0	D=0	8.962.168,57	0,68%	-0,50%	do IMA-B	13.535.810.679	0,07%							
AZQUEST FFPREV	Yield FIQRF LP CNPJ 16.599.968/0001-16	D=0	D=1	6.681.510,22	0,51%	-0,24%	do CDI	317.137.224	2,11%							
ITAÚ	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D=0	D=1	12.924.956,81	0,98%	-0,23%	IPCA	4.773.930.450	0,27%							
ITAÚ FFPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D=0	D=1	10.299.114,72	0,78%	-0,23%	IPCA	4.773.930.450	0,2%							
ICATU FFPREV	Icatu Yang Infl Curta FI RF - 10.922.432/0001-03	D=0	D=1	6.658.440,82	0,51%	-0,22%	do IMA-B5	617.958.021	1,08%							
ICATU	Icatu Yang Infl Curta FI RF - 10.922.432/0001-03	D=0	D=1	19.967.393,39	1,52%	-0,22%	do IMA-B6	617.958.021	3,23%							
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	D=0	D=1	2.588.286,41	0,20%	-1,60%	do IMA-B	1.950.918.735	0,13%							
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D=0	D=1	12.650.985,02	0,96%	-0,19%	do IMA-B5	788.410.647	1,60%							
Bradesco	Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	D=0	D=1	68.819.504,29	5,24%	-1,60%	do IMA-B	1.950.918.735	3,53%							
Bradesco	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D=0	D=1	16.865.339,93	1,28%	-0,19%	do IMA-B5	788.410.647	2,14%							
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"				8.245.966,31	0,63%											
Ourinvest	Suppliercard Senior 1 - 08.692.888/0001-82	D=120	D=121	8.221.893,85	0,63%	0,36%	do CDI	978.664.147	0,84%							
BVA	Multisetorial Master II - 11.989.256/0001-90	Fechado	Fechado	24.072,45	0,00%	-27,13%	do CDI	561.691	4,29%							
Trend Bank	Senior Multisetorial - 08.927.488/0001-09	Fechado	Fechado	0,01	0,00%	0,00%	do CDI	1	1,00%							

Western Asset FFPREV	LEGG MASON - CNPJ: 28.320.600/0001-56	D+1	D+5	6.138.021,01	0,47%	-3,99%	Russel 1000	129.106.231	4,75%	Ações Inv Ext	15%
Western Asset	MACRO DOLAR MM IE - CNPJ: 23.872.712/0001-04	D+1	D+5	6.880.195,07	0,52%	1,43%	DOL-D2	81.022.358	8,49%	MM Inv Ext	5%
Western Asset FFPREV	MACRO DOLAR MM IE - CNPJ: 23.872.712/0001-05	D+1	D+5	6.880.195,07	0,52%	1,43%	DOL-D2	81.022.358	8,49%	MM Inv Ext	5%
Western Asset	MACRO FIM IE - CNPJ: 22.282.992/0001-20	D+1	D+5	5.209.104,06	0,40%	-1,34%	DOL-D3	988.503.059	0,53%	MM Inv Ext	5%
Western Asset FFPREV	MACRO FIM IE - CNPJ: 22.282.992/0001-20	D+1	D+5	5.209.104,06	0,40%	-1,34%	DOL-D3	988.503.059	0,53%	MM Inv Ext	5%
SCHRODER	ACOES GLOBAIS - IE CNPJ: 37.308.394/0001-50	D+1	D+4	2.328.184,03	0,18%	-0,62%	MCSI World	9.907.488,91	23,50%	Ações Inv Ext	15%
SCHRODER FFPREV	ACOES GLOBAIS - IE CNPJ: 37.308.394/0001-50	D+1	D+4	2.504.171,30	0,19%	-0,62%	MCSI World	9.907.488,91	25,28%	Ações Inv Ext	15%

Fundo de Ações - BDR-Nível 1 (Investimentosno Exterior) - Art. 9º-A, Inciso III				27.346.391,38							
Western Asset	ACOES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D+1	D+5	13.557.974,42	1,03%	-1,40%	NA	1.984.282.330	0,68%	Ações Inv Ext	2,08%
Western Asset FFPREV	ACOES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36	D+1	D+5	13.788.416,96	1,05%	-1,40%	NA	1.984.282.330	0,69%	Ações Inv Ext	10%

Disponibilidade de Caixa											
Disponibilidade de Caixa				468.970,72	0,04%					0,04%	0%
Disponibilidade em Caixa FFIN1				442.466,13	0,03%						
Disponibilidade em Caixa Honorário Sucumbência (BB)				3.129,89	0,00%						
Disponibilidade - Saldo Consignados CEF				-	0,00%						
Disponibilidade em Caixa FFIN2(BB+Santander+Itaú+CEF)				-	0,00%					Disponibilidade	
Disponibilidade em Caixa FFPREV				23.374,70	0,00%						
TOTAL DE ATIVOS				1.312.745.957,18	100,00%					88,66%	

Meta Atuarial(INPC+ 5,26%aa)= (+) 0,87 + 0,428108)	1,30%	IBOVESPA	-4,80%	IFIX	0,46%	IRF-M	-0,56%	Consolidado - Ano	-1,18%
Rentabilidade no mês SBCPREV Consolidado	-2,19%	IBRX	-4,58%	IMA-B	-1,51%	IRFM 1	0,15%	Meta Atuarial - Ano	6,05%
INPC	0,87%	IBRX50	-4,62%	IMA-G	-0,60%	IRFM 1+	-0,91%	Consolidado - 12 meses	3,40%
CDI	0,16%	SMLL	-5,44%	IMA-B 5	-0,12%	IMA-C	-0,56%	Meta Atuarial - 12 Meses	9,55%
IPCA	0,64%	IDIV	-4,63%	IMA-B 5+	-2,60%	IMA-S	-0,27%		513.652.510,78

Total FFIN2 + FFINPrev **1.312.745.957,18**

Renda Fixa	rentabilidade no mês	-1,03%	833.014.297,01	63,46%	Renda Fixa	833.014.297	63,46%
Renda Variável	rentabilidade no mês	-5,26%	349.352.526,89	26,61%	Renda Variável	349.352.527	26,61%
Exterior	rentabilidade no mês	-0,10%	129.910.162,56	9,90%	Exterior	129.910.163	9,90%
Disponibilidade Caixa		-2,19%	468.970,72	0,04%	Disponibilidade de Caixa	468.971	0,04%
			1.312.745.957,18	100,00%	Total Geral	1.312.745.957	100,00%

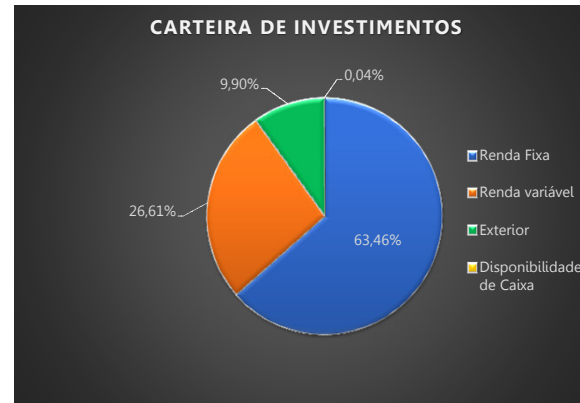
VaR

CARTEIRA DE INVESTIMENTO

META	SBCPREV	DIFER					
12,49	11,18	-1,19					
12,7	22,41	+9,71					
12,03	-6,03	-18,06					
12,75	10,45	-2,30					
17,81	9,54	-8,27					
12,97	20,00	+7,03					
8,11	15,30	+7,19					
9,58	12,39	+2,81					

CONSOLIDADO	Setembro 2020	1.312.745.957,18	100,00%	100,00%
RENDA FIXA	833.014.297,01	63,46%	100,00%	Pol Inv
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)	222.710.941,43	16,97%	100,00%	0
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)	371.620.915,58	28,31%	100,00%	1
Art. 7º, Inciso I, Alínea C (Índice ETF)	0,00	0,00%	100,00%	0
Art. 7º, Inciso II (Op.Compromissadas)	0,00	0,00%	5,00%	0
Artigo 7º, Inciso III "A" (Fundos Referenciados)	16.637.718,46	1,27%	60,00%	0
Art. 7º, Inciso III, Alínea "B" (Índices ETF Referenciados)	0,00	0,00%	60,00%	0
Artigo 7º, Inciso IV "A" (Fundos RF abertos)	213.798.755,23	16,29%	40,00%	0
Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B" (Índices ETF abertos)	0,00	0,00%	40,00%	0
Art. 7º, Inciso V, Alínea "B" (Letras Imobiliárias Garantidas)	0,00	0,00%	20,00%	0
Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A" (CDB)	0,00	0,00%	15,00%	0
Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B" (poupança)	0,00	0,00%	15,00%	0
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A" (FIDC cotas Sênior)	8.245.966,31	0,63%	5,00%	0
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B" (Fundos Crédito Privado)	0,00	0,00%	5,00%	0
Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C" (Fundos Debêntures InfraEstrutura)	0,00	0,00%	5,00%	0
RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS	349.352.526,89	26,61%	50,00%	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FIA abertos índices)	0,00	0,00%	30,00%	0
Art. 8º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos ETF índices)	0,00	0,00%	30,00%	0
Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" (FIA aberto carteira livre)	265.172.776,12	20,20%	20,00%	0
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)	0,00	0,00%	20,00%	0
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)	51.272.645,57	3,91%	10,00%	0
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)	20.965.033,19	1,60%	5,00%	0
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliário)	11.942.072,01	0,91%	5,00%	0
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - Fações - Mercado de Acesso	-	0,00%	5,00%	0
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	129.910.162,56	9,90%	10,00%	
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º-A, Inciso I	-	0,00%	10,00%	
Investimento no Exterior- Art. 9º-A, Inciso II	102.863.771,18	7,81%	10,00%	
Fundo de Ações - BDR-Nível 1 - Art. 9º-A, Inciso III	27.346.391,38	2,08%	10,00%	
Disponibilidade de Caixa	468.970,72	0,04%	0,00%	

Títulos Públicos	222.710.941,43	16,97%
CEFederal	166.967.842,50	12,72%
Santander	173.639.621,86	13,23%
Banco do Brasil	122.163.549,35	9,31%
Itaú	94.539.901,49	7,20%



Bradesco	100.924.115,65	7,69%
AZQuest	72.910.863,82	5,55%
Western	108.608.738,57	8,27%
ARX Investimentos	30.881.968,25	2,35%
Safra	20.181.465,80	1,54%
Kinea/Itau	16.977.181,70	1,29%
Icatu Vanguard	35.085.160,51	2,67%
Sul América	14.339.954,65	1,09%
Occan	11.952.040,24	0,91%
RBCapital	7.552.072,01	0,58%
Vinci Partner's/CEF	15.760.553,64	1,20%
Ourinvest	8.221.893,85	0,63%
Mongeral Aegon	8.034.225,70	0,61%
Reag	4.390.000,00	0,33%
XP Investimentos	34.796.283,77	2,65%
BTG Pactual	4.450.581,98	0,34%
BRZ	304.180,09	0,02%
TrendBank	0,01	0,00%
BVA	24.072,45	0,00%
Vinci Partner's FIP	1.567.216,89	0,12%
Perfin	1.830.180,87	0,14%
Moat	28.630.024,05	2,18%
SCHRODER	4.832.355,33	0,37%

Saldo Caixa	468.970,72	0,04%
	1.312.745.957,18	100,00%

RENDA FIXA

	% do total		% da Rfixa	
Títulos Públicos	16,97%	222.710.941,43	26,74%	
IMA-B	14,29%	187.534.011,11	22,51%	
IMA-B5	16,34%	214.492.578,09	25,75%	
IMA-B5 - ATIVO	1,22%	15.980.686,95	1,92%	
Alocação Dinâmica	3,99%	52.321.898,77	6,28%	
IRF-M	8,77%	115.130.396,92	13,82%	
DI + Outros R Fixa	1,26%	16.597.817,43	1,99%	
FIDC	0,63%	8.245.966,31	0,99%	
	0,00%		0,00%	
	63,46%	833.014.297,01	100,00%	0,63

RENDA VARIÁVEL

	% do total		% da Rvariável
Ações Índice 8-I-a	0,00%	-	0,00%
ETF Ações 8-I-b	0,00%	-	0,00%
Ações Livre Geral 8-II-a	11,83%	155.260.017,94	44,44%
Dividendos Ações Livre Geral 8-II-a	5,22%	68.513.511,93	19,61%
Small Caps Ações Livre Geral 8-II-a	3,15%	41.399.246,25	11,85%
ETF Ações Livre Geral 8-II-b	0,00%	0,00	0,00%
Multimercados 8-III	3,91%	51.272.645,57	14,68%
FIP Fechado 8-IV-a	1,60%	20.965.033,19	6,00%
FImobiliário 8-IV-b	0,91%	11.942.072,01	3,42%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c	0,00%	-	0,00%
Total	26,61%	349.352.526,89	100,00%

EXTERIOR

Renda Fixa -Dívida Externa - 9ªA, inciso I	-	0
Investimento Exterior 9ªA, inciso II	102.563.771,18	78,95%
Ações BDR-Nível 1 - 9ªA, inciso III	27.346.391,38	21,05%

Total	129.910.162,56	100,00%
--------------	-----------------------	----------------

Disponibilidade de Caixa	468.970,72
--------------------------	------------

TOTAL GERAL	1.312.745.957,18
--------------------	-------------------------