

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 31/12/2020

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Rogate	Rogate	VLR. APLICADO	Atividade				PI do Fundo	% s/PI do Fundo	SEGMENTO / CATEGOR	Limites				NORMA		
					Nominal	% Patr do Rote	Mês	% Benchmark ano				Aplicado RPPS	RESOL 3.922 + Wot 1 Prô Gestão	Politic Invest	% do Fundo		Máx PI do Rote por Fundo	Equad. Resol. 3922/2010
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																		
54.414.128,87 9,52%																		
CFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (p/ica) venc 15/05/2023 - 2.000			7.725.603,08	1,35%	5,32%	IPCA + 6,35 % aa		2,2538		Renda Fixa TP	9,52%	100%	40%	0%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A"		
CFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (p/ica) venc 15/05/2026 - 4.000			14.145.839,07	2,48%	5,32%	IPCA + 6,248 % aa				Renda Fixa TP	9,52%	100%	40%	0%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A"		
CFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (p/ica) venc 15/05/2035 - 4.000			18.079.270,40	3,16%	5,32%	IPCA + 5,688 % aa				Renda Fixa TP	9,52%	100%	40%	0%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A"		
CFederal (custodiante) FFPREV	NTN-B (p/ica) venc 15/05/2035 - 3.200			14.463.416,32	2,53%	5,32%	IPCA + 7,484 % aa				Renda Fixa TP	9,52%	100%	40%	0%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A"		
Fundos Referenciados Renda Fixa que contêm 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B																		
221.499.612,45 38,76%																		
Santander FFPREV	FIC FIMA-B5 Titulos Públ. - 13.455.117/0001/01	D=0	D=1	34.459.555,71	6,03%	1,81%	do IMA-B		1.203.216.550	2,86%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
Santander FFPREV	FI IRF-M Titulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D=0	D=1	14.091.507,51	2,47%	1,98%	do IRF-M		2.580.920.672	0,55%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
Santander FFPREV	FI IMA-B Titulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D=0	D=1	25.715.894,94	4,50%	4,82%	do IMA-B		1.116.892.204	2,30%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
Bco do Brasil FFPREV	BB PRevid RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D=0	D=1	12.393.445,60	2,17%	1,96%	do IRF-M		8.554.614.280	0,14%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
Bco do Brasil FFPREV	BB PRevid RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D=0	D=1	14.398.547,66	2,52%	1,81%	do IMA-B5		4.987.516.426	0,29%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
CEF FFPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D=0	D=0	41.728.062,84	7,30%	1,96%	do IRF-M		3.566.953.491	1,17%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
CEF FFPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TP RF - 11.060.913/0001-10	D=0	D=0	42.420.875,80	7,42%	1,82%	do IMA-B5		20.761.505.099	0,20%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
CEF FFPREV	CAIXA FIC BRASIL GEST ESTR RF - 23.215.097/0001-56	D=0	D=0	14.434.269,36	2,53%	1,32%	do IMA-B5		14.722.139.597	0,10%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
Sul América - FFPREV	INFILATIE FI RF LP 09.326.708/0001-01	D=1	D=3	15.343.649,83	2,68%	4,58%	do IMA-B		1.248.585.235	1,23%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
Western Asset FFPREV	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D=0	D=1	6.513.803,20	1,14%	3,23%	do IMA-B5		941.494.566	0,69%	Renda Fixa TP	38,76%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"	
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contêm 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C																		
17.820.621,99																		
Operações Compromissadas Lastreadas 100% em TP do TN - Art. 7º, Inciso II																		
17.820.621,99																		
Fundos "Referenciados" em Indicadores Rf (podem ter crédito privado) - Art. 7º, Inciso II, Alínea "A"																		
15.272.591,12 2,67%																		
CEF FFPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D=0	D=0	15.272.591,12	2,67%	4,85%	do IMA-B		2.989.829.287	0,51%	Renda Fixa Referenciado	0,00%	65%	35%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "A" (15% PI do FI)	
Mongeral Aegon FFPREV	Mongeral Aegon Infr IMA-B - 14.115.118/0001-70	D=2	D=3	2.548.030,87	0,45%	5,01%	do IMA-B		131.500.462	1,94%	Renda Fixa Referenciado	0,00%	65%	35%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "A" (15% PI do FI)	
Fundos de Renda Fixa Geral - Art. 7º, Inciso II, Alínea "A"																		
47.252.419,65 8,27%																		
Santander FFPREV-491-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45	D=0	D=0	7.490.838,46	1,31%	0,26%	do CDI		1.591.072.731	0,47%	Renda Fixa	8,27%	45%	35%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso IV "A"	
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - 08.702.798/0001-25	D=0	D=1	2.773.536,65	0,49%	4,94%	do IMA-B		2.099.544.961	0,13%	Renda Fixa	8,27%	45%	35%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso IV "A"	
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D=0	D=1	13.059.332,51	2,28%	1,78%	do IMA-B5		954.945.017	1,37%	Renda Fixa	8,27%	45%	35%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso IV "A"	
AZQUEST FFPREV	Yield FICOR LP CNPJ 16.599.968/0001-16	D=0	D=1	6.712.140,87	1,17%	0,44%	do CDI		288.493.676	2,33%	Renda Fixa	8,27%	45%	35%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso IV "A"	
ITAÚ FFPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D=0	D=1	10.338.744,83	1,81%	0,20%	do IPCA		3.882.685.364	0,27%	Renda Fixa	8,27%	45%	35%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso IV "A"	
ICATU FFPREV	ICatu Vang Infr Carta FI RF - 10.922.432/0001-03	D=0	D=1	6.877.826,33	1,20%	1,81%	do IMA-B5		872.184.819	0,79%	Renda Fixa	8,27%	45%	35%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso IV "A"	
Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Qualquet Indicador - Art. 7º, Inciso II, Alínea "B"																		
Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, Inciso II, Alínea "B"																		
Certificados de Depósitos Bancários - CDI (limitado ao FIC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"																		
Poupança (limitado ao FIC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"																		
RDC Cotas Sênior - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"																		
Fundo de Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B"																		
Fundo de Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "C"																		
INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS																		
19.188.076,99 3,36%																		
Fundo de Ações Índices - com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"																		
0,00%																		
Fundo de Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"																		
0,00%																		
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "A"																		
132.063.689,71 23,11%																		
ITAÚ FFPREV	Instit Ações Phoenix FIA - 23.731.629/0001-07	D=21	D=24	17.345.312,26	3,03%	7,97%	do IBOV		1.462.115.658	1,19%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
ITAÚ FFPREV	Instit Ações Dunamis FICFIA - 24.571.952/0001-75	D=21	D=23	15.317.844,53	2,68%	6,30%	do IBOV		3.595.641.285	0,43%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
AZQUEST FFPREV	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D=27	D=29	12.081.428,60	2,11%	6,93%	do SMLL		1.356.738.390	0,9%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
AZQUEST FFPREV	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D=1	D=1	8.591.458,91	1,50%	7,67%	do IBOV		812.622.043	1,1%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
AZQUEST FFPREV	SMALL MID CAPS RPPS FIC FIA - 34.791.108/0001-61	D=27	D=29	5.651.521,84	0,99%	6,93%	do IBOV		556.827.249	1,0%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
XP Investimentos FFPREV	XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12	D=1	D=1	6.513.648,26	1,14%	8,22%	do IDIV		252.724.483	2,58%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
CEF VIV Partner's FFPREV	FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15	D=30	D=32	4.050.994,94	1,19%	9,37%	IDIV		1.002.176.394	0,40%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
CEFederal FFPREV	FIC ACOES VALOR RPPS CNPJ: 14.507.699/0001-95	D=21	D=23	22.328.379,45	6,55%	9,08%	IDIV		756.510.912	2,95%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
OCCAN FFPREV	OCCAMFIC FIA CNPJ 11.628.883/0001-03	D=15	D=17	14.678.898,97	4,30%	10,11%	do IBOV		1.060.739.165	1,38%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
PERFIN FFPREV	Perfin Instituc. FIC FIA CNPJ 10.608.762/0001-29	D=30	D=33	914.542,48	0,27%	4,60%	do IBOV		361.432.702	0,25%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
MOAT FFPREV	Moat Capital Advisory FIC FIA CNPJ: 35.354.967/0001-56	D=15	D=17	14.877.842,33	4,36%	7,05%	do IBOV		1.260.197.171	1,18%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
BTG Pactual FFPREV	ABSOLUT INS FIC FIA CNPJ: 11.977.794/0001-64	D=30	D=32	2.623.312,27	0,77%	5,26%	do IBOV		2.636.774.357	0,10%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
ICATU FFPREV	ICatu Vang Dividendos FIA - 08.279.304/0001-41	D=1	D=3	7.088.504,87	1,24%	7,96%	do IDIV		1.793.128.514	0,40%	Renda Variável	23,11%	25%	30%	10%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
Fundo ETF Índices em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"																		
19.188.076,99																		
Fundos Multimercados - Aberto (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso III																		
2.619.156,81 0,46%																		
Mongeral Aegon FFPREV	Mongeral Aegon FIM CNPJ 14.115.116/000180	D=0	D=1	2.619.156,81	0,46%	1,08%	do CDI		134.791.132	1,94%	Renda Variável	3,36%	10%	10%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso III	
CEFederal FFPREV	Cap Prot Bolsa II Multim CNPJ 22.790.987/0001-28	D=0	D=21	2.123.326,64	0,62%	1,21%	do CDI		105.480.845	2,01%	Renda Variável	3,36%	10%	10%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso III	
CEFederal FFPREV	Cap Prot Bolsa III Multim CNPJ 18.007.358/0001-01	D=0	D=28	2.414.636,13	0,71%	1,34%	do CDI		112.055.792	2,15%	Renda Variável	3,36%	10%	10%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso III	
Western Asset FFPREV	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D=0	D=1	12.030.957,41	2,11%	3,18%	do CDI		1.201.804.027	1,00%	Renda Variável	3,36%	10%	10%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso III	
Fundo de Participações - FIP (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"																		
11.871.855,10 2,08%																		
Vinci Cap Partners III FFPREV	FIP Multisregião II CNPJ 30.507.217/0001-53	Fechado	Fechado	986.575,22	0,17%	60,78%	do IPCA		78.893.990	1,25%	FIP Participações	2,08%	5%	4%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A"	
Kinea IV Feeder FFPREV	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	8.100.547,95	1,42%	0,25%	1.3333431	171.836.682,00	IPCA	215.339.548	3,76%	FIP Participações	2,08%	5%	4%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A"
BTG Pactual FFPREV	EconReal FIP Multiregion CNPJ 35.640.811/0001-31	Fechado	Fechado	2.784.731,93	0,49%	-0,75%	0.9820915	367.707.273,00	IPCA	361.122.940,75	#####	FIP Participações	2,08%	5%	4%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A"
Fundo Imobiliário FI - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"																		
0,00%																		
Fundo de Ações - Mercado de Acesso (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C"																		
0,00%																		
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR																		
67.421.433,38 11,80%																		
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa (Investimentos Exterios) - Art. 9º A, Inciso I																		
53.572.656,75																		
Investimentos no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º A, Inciso II																		
SANTANDER FFPREV	GLOBAL EQUITIES IE CNPJ: 17.804.792/0001-50	D=1	D=6	7.998.492,03	1,40%	0,47%	MSCI World		1.055.348.442	0,76%	MM Inv Ext							
Bco do Brasil/Morgan FFPREV	BB MM GLOBAL SELECT - 17.413.630/0001-68	D=1	D=5	9.013.021,15	1,58%	3,09%	MSCI World		1.391.937.780	0,6%	MM Inv Ext							
XP Inv/Morgan Stanley	MS GLOBAL OPP FIC FIA IE CNPJ 13.313.542/0001-85	D=1	D=5	15.055.854,16	2,63%	0,18%	MSCI World		1.275.079.811	1,18%	Ações Inv Ext							
Western Asset FFPREV	LEGG MASON - CNPJ: 28.320.600/0001-56	D=1	D=5	6.601.639,61	1,16%	2,21%	Russel 1000		187.259.357	3,53%	Ações Inv Ext	9,37%	10%	10%	10%	20%	Artigo 9º A, Inciso II	
Western Asset FFPREV	MACRO DOLAR MM IE - CNPJ: 23.872.712/0001-01	D=1	D=5	6.298.257,92	1,17%	2,04%												

CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA			
Títulos Públicos		54.414.128,87	9,77%
CEFederal		126.287.871,98	22,67%
Santander		89.756.288,65	16,11%
Banco do Brasil		35.805.014,41	6,43%
Itaú		43.001.901,62	7,72%
Bradesco		15.832.869,16	2,84%
AZQuest		33.036.550,22	5,93%
Western		51.200.546,14	9,19%
Sul América		15.343.649,83	2,75%
ARX Investimentos		0,00	0,00%
Safra		0,00	0,00%
Kinea/Itau		8.100.547,95	1,45%
Icatu Vanguard		13.966.331,20	2,51%
RBCapital		0,00	0,00%
Occan		14.678.898,97	2,63%
Vinci Partner's/CEF		4.050.994,94	0,73%
Oquirvest		0,00	0,00%
Mongeral Aegon		5.167.187,68	0,93%
Reag		0,00	0,00%
XP Investimentos		21.569.502,42	3,87%
BTG Pactual		5.408.044,20	0,97%
BRZ		0,00	0,00%
TrendBank		0,00	0,00%
BVA		0,00	0,00%
Vinci Partner's		986.575,22	0,18%
Misat		14.877.842,33	2,67%
Perfin		914.542,48	0,16%
SCHRODER		2.698.280,51	0,49%
Saldo Caixa		0,52	0,00%
TOTAL		557.097.569,30	99,52%

RENDA FIXA			
	% do total		% da Rfixa
Títulos Públicos	9,52%	54.414.128,87	16,66%
IMA-B	10,79%	61.653.703,41	18,88%
IMA-BS	19,46%	111.216.138,01	34,06%
IMA-BS - ATIVO	1,14%	6.513.803,20	1,99%
Alocação Dinâmica	1,81%	10.338.744,83	3,17%
INF-M	11,94%	68.213.015,95	20,89%
DI + Outros R Fixa	2,49%	14.202.979,33	4,35%
FIDC	0,00%	0,00	0,00%
	57,14%	326.552.513,60	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	13,01%	74.349.211,75	45,58%
Dividendos Ações Livre Geral 8-II-a	7,98%	45.633.049,36	27,97%
Small Caps Ações Livre Geral 8-II-a	2,11%	12.081.428,60	7,41%
ETF Ações Livre Geral 8-II-b	0,00%	0,00	0,00%
Multimercados 8-III	3,36%	19.188.076,99	11,76%
FIP Fechado 8-IV-a	2,08%	11.871.855,10	7,28%
Fimobiliário 8-IV-b	0,00%	-	0,00%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c	0,00%	-	0,00%
Total	28,54%	163.123.621,80	100,00%

EXTERIOR			
Renda Fixa - Dívida Externa - 99A, inciso I	0,00%	-	0
Investimento Exterior 99A, inciso II	9,37%	53.572.656,75	0,79459
Ações BDR-Nível 1 - 99A, inciso III	2,42%	13.848.776,63	0,20541
	0,00%		0
Total	11,80%	67.421.433,38	1

Disponibilidade Financeira 0,52

TOTAL 557.097.569,30