

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 31/10/2021

Table with columns: INSTITUIÇÕES, FUNDOS / CNPJ, Conversão, Reagite, VLR. APLICADO, Rentabilidade (Mês, Ano, 12 Meses, 24 Meses, % Benchmark ano), Limites (PL do Fundo, %/PL do Fundo), SEGMENTO / CATEGORIA, Limites (Aplicado RPPS, RESOL 3.922 + Nível 1 Fide Gestão, Public Invest, Fide 60, Fide 90, Fide RPPS por Fundo), NORMA (Enquad. Resol 3922/2010)

INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA
Títulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea A
NTN-B (lpcal) venc 15/08/2026 - 3.400
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 3.450
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 6.000
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2023 - 2.000
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2023 - 7.600
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 8.500
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 3.200
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 13.000
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2035 - 4.000
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2045 - 6.000 Conta Selic LM: 6389789
NTN-B (lpcal) venc 15/08/2040 - 6.000 Conta Selic LM: 6389789
NTN-B (lpcal) venc 15/05/2045 - 10.000 Conta Selic LM:
NTN-B (lpcal) venc 15/08/2040 - 5.075 Conta Selic LM:
NTN-B (lpcal) venc 15/08/2040 - 4.925 Conta Selic LM:
Total: 330.100.241,03

Fundos Referenciados Renda Fixa que constam em 100% PL do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B
CEFF FFPREV
Safra FFPREV Migr
CEFF FFPREV
CEFF FFPREV
Bco do Brasil FFPREV
Santander FFPREV
Santander FFPREV
Western Asset FFPREV
Bco do Brasil FFPREV
Santander FFPREV
Bco do Brasil FFPREV Migr
Sul América - FFPREV
ICATU FFPREV

Fundos de Índice ETF Renda Fixa que constam em 100% PL do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C
Operações Compromissadas Lastreadas 100%em PL do TN - Art. 7º, Inciso B
Fundo "Referenciados" em indicadores RFIAs (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso II, Alínea "A"
CEFF FFPREV
Mongeral Aegon FFPREV

Fundos de Índice ETF Renda Fixa em Indicadores de Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso II, Alínea B
Fundo de Renda Fixa Geral - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "A"
ITAU FFPREV
Bco do Brasil FFPREV Migr
Bradesco FFPREV
Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 20.316.316/0001-04
Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25
AQUEST FFPREV
Yield FIDRUF LP CNPJ 16.599.968/0001-16
Bco do Brasil FFPREV

Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Demais Índices - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"
Letras Imobiliárias Garantidas - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"
Certificados de Depósitos Bancários - CDB - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"
Poupança - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B"
FIDC Cotas Sênior - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A"
FIDC Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B"
Fundo de Debitantes de Infraestrutura - Art. 7º, Inciso VIII, Alínea "C"
Fundo de Ações Referenciado - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"
Fundo de Índices ETP Referenciado - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"
Fundo de Índice ETP Renda Fixa - Quaisquer Indicadores - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"
Letras Imobiliárias Garantidas - 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"
Ourinvest FFPREV Migr
BVA FFPREV Migr
Trend Bank FFPREV Migr
Fundo de Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, Inciso VIII, Alínea "B"
Fundo de Debitantes de Infraestrutura - Art. 7º, Inciso VIII, Alínea "C"

INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"
Fundo de Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "A"
ITAU FFPREV Migr
AQUEST FFPREV
ITAU FFPREV Migr
XP Investimentos FFPREV
ITAU FFPREV
ICATU FFPREV
CEFF Nuvem Partners FFPREV
OCCAM FFPREV
Vinci Partners FFPREV Migr
PERFIN FFPREV
ITAU FFPREV
CEFederal FFPREV
AQUEST FFPREV
MOAT FFPREV
BTG Pactual FFPREV
ARX Investimentos FFPREV Migr
TARPON GT 30 FIC FIA FFPREV
Bco do Brasil FFPREV

Fundo ETP Índice em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"
Fundo Multi-mercado - Aberto (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso II
Western Asset FFPREV
Mongeral Aegon FFPREV
CEFederal FFPREV
CEFederal FFPREV
Fundo de Participações - FIP (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"
BTG Pactual FFPREV Migr
Kinea II FFPREV Migr
BZ Brasil Portos FFPREV Migr
Kinea IV Feeder FFPREV
Vinci Cap Partners III FFPREV
BTG Pactual FFPREV
BTG Pactual FFPREV
Fundo Imobiliário FI - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"
Reag Renda Imob FFPREV Migr
RB Capital FFPREV Migr

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa (Investimentos Externo) - Art. 9º A, Inciso I
Investimento no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º A, Inciso II
SANTANDER FFPREV
Western Asset FFPREV
Western Asset FFPREV
Bco do Brasil JP Morgan FFPREV
XP Inv/Morgan Stanley
SCHRODER FFPREV
XP Nuberg/Berman FFPREV
Western Asset FFPREV
Disponibilidade de Caixa
TOTAL DE ATIVOS

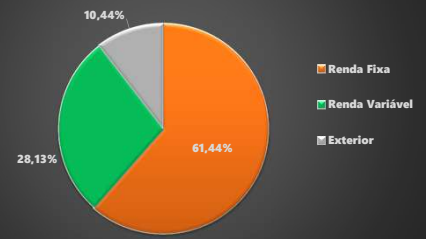
Meta Atuarial (INPC + 4,00%) - (-) 1.16 - 0,327374
Rendibilidade no mês SBCPREV FFPREV
INPC
CDI
IPCA
Total FFIN2 + FFINPrev

CARTEIRA DE INVESTIMENTO
Renda Fixa
Renda Variável
Exterior
Total de Investimentos
Disponibilidade Caixa
Total Geral

FFPREV Outubro 2021

	1.403.741.588,41	100,00%	100,00%
REDA FIXA	862.142.300,50	61,42%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)	330.100.241,03	23,52%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)	390.940.224,39	27,85%	100,00%
Art. 7º, Inciso I, Alínea C (Índice ETF)	0,00	0,00%	100,00%
Art. 7º, Inciso I (Op.Compromissadas)	0,00	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso II "A" (Fundos Referenciados)	16.926.339,52	1,21%	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)	115.427.423,83	8,22%	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)	8.748.071,73	0,62%	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%
REDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS	394.683.692,71	28,12%	50,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FIA abertos indices)	0,00	0,00%	30,00%
Art. 8º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos ETF indices)	0,00	0,00%	30,00%
Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" (FIA aberto carteira livre)	289.954.946,68	20,66%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)	0,00	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)	55.455.905,06	3,95%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP Fechada)	40.104.137,23	2,86%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliária)	9.168.703,74	0,65%	5,00%
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - FApções - Mercado de Acesso	0,00	0,00%	5,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	146.430.294,24	10,43%	10,00%
Art. 9ºA, Inciso I - Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa	0,00	0,00%	10,00%
Art. 9ºA, Inciso II - Investimento no Exterior	110.777.700,63	7,89%	10,00%
Art. 9ºA, Inciso III - Fundo deApções - BDR-Nível 1	35.652.593,61	2,54%	10,00%
Disponibilidade de Caixa	485.300,96	0,03%	0,00%

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS



CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Títulos Públicos	330.100.241,03	23,52%
CEFederal	150.261.880,29	10,70%
Santander	136.971.198,41	9,76%
Banco do Brasil	182.283.309,47	12,99%
Itau	82.142.521,10	5,85%
Bradesco	49.361.080,29	3,52%
AZQuest	71.305.519,25	5,08%
Western	114.030.078,32	8,12%
Sul América	14.127.135,34	1,01%
ARX Investimentos	33.046.410,43	2,35%
Safra	19.955.856,35	1,42%
Kinea/Itau	23.070.994,36	1,64%
Icatu Vanguard	36.147.521,99	2,58%
RBCapital	5.696.703,74	0,41%
Ocean	12.715.347,52	0,91%
Vinci Partner's/CEF	17.156.528,43	1,22%
Ourlinvest	8.737.433,12	0,62%
Mongeral Aegon	8.233.893,12	0,59%
Reag	3.472.000,00	0,25%
XP Investimentos	44.781.671,69	3,19%
BTG Pactual	14.217.817,32	1,01%
BRZ	481.079,71	0,03%
TrendBank	0,01	0,00%
BVA	10.638,60	0,00%
Vinci Partner's	4.265.559,71	0,30%
Moat	26.550.176,49	1,89%
Perfin	1.567.146,80	0,11%
SCHRODER	6.738.650,57	0,48%
Tarpon	5.827.793,99	0,42%
Saldo Caixa	485.300,96	0,03%
TOTAL	1.403.741.588,41	100,00%

REDA FIXA

	% do total		% da Rfixa
Títulos Públicos	23,52%	330.100.241,03	38,29%
IMA-B	8,48%	119.004.002,01	13,80%
IMA-BS	17,89%	251.162.538,91	29,13%
IMA-BS - ATIVO	1,15%	16.149.834,32	1,87%
Alocação Dinâmica	4,86%	56.975.518,75	6,61%
IBF-M	2,60%	36.470.864,01	4,23%
DI + Outros R Fixa	0,47%	6.634.874,06	0,77%
FIDC	0,62%	8.748.071,73	1,01%
IPCA	2,63%	36.896.355,08	4,28%
	61,42%	862.142.300,50	100,00%

REDA VARIÁVEL

	% do total		% da Rvariável
Ações Índice Outros 8-I-a	0,00%	0,00	0,00%
ETF Ações 8-I-b	0,00%	0,00	0,00%
Ações Livre Geral 8-II-a	13,93%	195.573.179,57	49,55%
Dividendos Ações Livre Geral 8-II-a	2,87%	40.235.376,03	10,19%
Small Caps Ações Livre Geral 8-II-a	3,86%	54.146.391,08	13,72%
ETF Ações Livre Geral 8-II-b	0,00%	0,00	0,00%
Multimercados 8-III	3,95%	55.455.905,06	14,05%
FIP Fechado 8-IV-a	2,86%	40.104.137,23	10,16%
Fimobiliário 8-IV-b	0,65%	9.168.703,74	2,32%
Ações - Mercado de Acesso 8-IV-c	0,00%	0,00	0,00%
Total	28,12%	394.683.692,71	100,00%

EXTERIOR

Renda Fixa - Dívida Externa - 9ºA, inciso I	0,00%	0,00	0%
Investimento Exterior 9ºA, inciso II	7,89%	110.777.700,63	76%
Ações BDR-Nível 1 - 9ºA, inciso III	2,54%	35.652.593,61	24%
	0,00%	0,00	0%
Total	10,43%	146.430.294,24	100%

Disponibilidade Financeira 485.300,96

TOTAL 1.403.741.588,41