# SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 4.963 - BASE: 31/07/2022

| INSTITUIÇÕES | FUNDOS / CNPJ | Conversão | Resgate | VLR. APLICADO Nominal | % Patr do RPPS | Rentabilidade Mês | Ano | 12 Meses | 24 Meses | | % Bechmark ano | | PL do Fundo | % s/PL do Fundo | SEGMENTO / CATEGORIA | Limites Aplicado RPPS | RESOL 4.963 + Nível 1 Pró | Politic Invest | %PL do Fundo | Máx PI do RPPS por Fundo | NORMA Enquadr.Resol.3922/2010 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA ART. 7º | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Carteira Própria - Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso I, Alínea A | | | | 427.648.391,64 | 28,90% | | | | | | | | | | | 28,90% | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 2.000 | | | 7.972.642,22 | 0,54% | -1,83% | | | | IPCA+6,35 % aa | | do IPCA | | | Renda Fixa TP | 28,90% | 100% | 100% | 100% | 100% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr | NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 7.600 | | | 30.296.040,42 | 2,05% | -1,83% | | | | IPCA+6,45 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400 | | | 13.920.226,85 | 0,94% | -1,83% | | | | IPCA+6,248 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr | NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.450 | | | 13.719.516,77 | 0,93% | -1,83% | | | | IPCA+6,23 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr | NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 6.000 | | | 23.860.029,16 | 1,61% | -1,83% | | | | IPCA+6,49 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr | NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 8.500 | | | 33.801.707,98 | 2,28% | -1,83% | | | | IPCA+7,484 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200 | | | 12.725.348,89 | 0,86% | -1,83% | | | | IPCA+7,484 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr | NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 13.000 | | | 51.696.729,85 | 3,49% | -1,83% | | | | IPCA+5,688 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000 | | | 15.906.686,11 | 1,07% | -1,83% | | | | IPCA+5,688 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 6.000 | | | 24.070.095,88 | 1,63% | -1,83% | | | | IPCA+4,941 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 5.075 | | | 20.359.289,43 | 1,38% | -1,83% | | | | IPCA+5,235 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 4.925 | | | 19.757.537,03 | 1,34% | -1,83% | | | | IPCA+5,235 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 6.200 | | | 24.872.432,41 | 1,68% | -1,83% | | | | IPCA+5,650 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 6.000 | | | 23.560.951,95 | 1,59% | -1,83% | | | | IPCA+4,961 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 6.300 | | | 24.738.999,55 | 1,67% | -1,83% | | | | IPCA+5,700 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 10.000 | | | 39.268.253,25 | 2,65% | -1,83% | | | | IPCA+5,255 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| XP Investimentos (custodiante) FFPREV | NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 12.000 | | | 47.121.903,90 | 3,18% | -1,83% | | | | IPCA+5,703 % aa | | do IPCA | | | | | | | | | |
| FI Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B | | | | 359.686.602,87 | 24,31% | | | | | | | | | | | 24,31% | | | | | |
| Bco do Brasil FFPREV Migr | BB Previd RF ALOC ATIVA FIC FI - 25.078.994/0001-90 | D+0 | D+3 | 21.555.257,60 | 1,46% | 0,41% | | | | | | do IMA-B5 | 4.928.627.960,16 | 0,44% | Renda Fixa TP | 24,31% | 100% | 100% | 100% | 100% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" |
| Bco do Brasil FFPREV | BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03 | D+0 | D+1 | 40.902.477,59 | 2,76% | 0,00% | | | | | | do IMA-B5 | 6.564.821.510,69 | 0,62% | | | | | | | |
| Bco do Brasil- FFPREV | BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69 | D+0 | D+1 | 14.508.826,11 | 0,98% | 1,13% | | | | | | do IRF-M | 2.837.899.627,90 | 0,51% | | | | | | | |
| CEF FFPREV | CAIXA FIC BRASIL GEST ESTR RF - 23.215.097/0001-55 | D+0 | D+0 | 29.586.703,12 | 2,00% | 0,79% | | | | | | do IMA-B5 | 6.217.671.822,00 | 0,48% | | | | | | | |
| CEF FFPREV | CX FI Brasil IMA-B5 TP RF - 11.060.913/0001-10 | D+0 | D+0 | 36.931.187,95 | 2,50% | 0,02% | | | | | | do IMA-B5 | 10.426.166.067,57 | 0,35% | | | | | | | |
| CEF FFPREV | FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00 | D+0 | D+0 | 12.358.624,39 | 0,84% | 1,12% | | | | | | do IRF-M | 1.657.612.299,94 | 0,75% | | | | | | | |
| ICATU FFPREV | Icatu Vang Infl Curta FI RF 10.922.432/0001-03 | D+0 | D+1 | 30.501.401,80 | 2,06% | 0,00% | | | | | | do IMA-B5 | 528.347.997,97 | 5,77% | | | | | | | |
| Safra FFPREV Migr | IMA-B FIC FI - 10.787.822/0001-18 | D+3 | D+4 | 21.090.862,15 | 1,43% | -1,00% | | | | | | do IMA-B | 392.541.506,77 | 5,37% | | | | | | | |
| Santander FFPREV | FIC FI IMA-B5 Títulos Públ. - 13.455.117/0001/01 | D+0 | D+1 | 76.611.189,44 | 5,18% | -0,01% | | | | | | do IMA-B5 | 1.121.658.731,38 | 6,83% | | | | | | | |
| Santander FFPREV | FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90 | D+0 | D+1 | 38.447.356,98 | 2,60% | -0,90% | | | | | | do IMA-B | 817.539.930,04 | 4,70% | | | | | | | |
| Santander FFPREV | FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03 | D+0 | D+1 | 12.175.221,85 | 0,82% | 1,15% | | | | | | do IRF-M | 445.118.953,02 | 2,74% | | | | | | | |
| Sul América - FFPREV | INFLATIE FI RF LP 09.326.708/0001-01 | D+1 | D+2 | 15.024.641,97 | 1,02% | -0,95% | | | | | | do IMA-B | 262.049.667,27 | 5,73% | | | | | | | |
| Western Asset FFPREV | WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78 | D+0 | D+1 | 9.992.851,92 | 0,68% | -0,14% | | | | | | do IMA-B5 | 527.910.513,07 | 1,89% | | | | | | | |
| Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Renda Fixa TP | 0,00% | 100% | 0% | 100% | 100% | Art. 7º, Inciso I, Alínea C |
| Operações Compromissadas com Lastro em TPF - Art. 7º, Inciso II | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Renda Fixa TP | 0,00% | 5% | 0% | - | - | Art. 7º, Inciso II |
| Fundos de Renda Fixa conforme CVM Art. 7º, Inciso III, Alínea A | | | | 138.675.535,90 | 9,37% | | | | | | | | | | | 9,37% | | | | | |
| Santander FFPREV 491-9 | FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-45 | D+0 | D+0 | 3.000.000,00 | 0,20% | 0,31% | | | | | | do CDI | 2.186.258.657,96 | 0,14% | Renda Fixa | 9,37% | 65% | 60% | 15% | 20% | Art. 7º, Inciso III, Alínea "A" ( 15% PL do FI) |
| Bco do Brasil FFPREV | BB PREV. RF ALOC ATIVA RETORNO TOTAL 35.292.588/0001-8 | D+3 | D+3 | 39.624.619,44 | 2,68% | 0,64% | | | | | | do IPCA | 3.323.314.760,57 | 1,19% | | | | | | | |
| Bco do Brasil FFPREV Migr | BB Previd RF IMA-B - 07.861.554/0001-22 | D+0 | D+1 | 14.251.029,55 | 0,96% | -0,95% | | | | | | do IMA-B | 766.955.657,92 | 1,86% | | | | | | | |
| Bradesco FFPREV | Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04 | D+0 | D+1 | 33.576.380,75 | 2,27% | -0,01% | | | | | | do IMA-B5 | 1.265.147.070,67 | 2,65% | | | | | | | |
| Bradesco FFPREV | Bradesco FIC FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25 | D+0 | D+1 | 20.069.356,41 | 1,36% | -0,96% | | | | | | do IMA-B | 702.174.152,32 | 2,86% | | | | | | | |
| CEF FFPREV | Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90 | D+0 | D+0 | 15.536.694,79 | 1,05% | -0,89% | | | | | | do IMA-B | 2.105.457.404,21 | 0,74% | | | | | | | |
| ITAÚ FFPREV | Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49 | D+0 | D+1 | 10.035.469,67 | 0,68% | 0,80% | | | | | | do IPCA | 2.528.329.321,30 | 0,40% | | | | | | | |
| Mongeral Aegon FFPREV | Mongeral Aegon Infl IMA-B 14.115.118/0001-70 | D+2 | D+3 | 2.581.985,29 | 0,17% | -0,97% | | | | | | do IMA-B | 172.360.003,74 | 1,50% | | | | | | | |
| Fundos de Índice ETF - Conforme CVM - Art. 7º, Inciso III, Alínea B | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Renda Fixa | 0,00% | 65% | 20% | 15% | 20% | Art. 7º, Inciso III, Alínea "B" |
| Ativos Financeiros de RF de emissão com obrigação ou coobrigação de Inst. Financeiras Bancárias autorizadas pelo BACEN-CDB, LFT, etc. - | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Renda Fixa | 0,00% | 20% | 20% | - | - | Artigo 7º, Inciso IV |
| Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - FIDC Cota Sênior - Art. 7º, Inciso V, Alínea A | | | | 9.626.737,65 | 0,65% | | | | | | | | | | | 0,65% | | | | | |
| Ourinvest FFPREV Migr | Suppliercard Senior 1 - 08.692.888/0001-82 | D+120 | D+121 | 9.598.568,32 | 0,65% | 1,23% | | | | | | do CDI | 1.623.784.142,38 | 0,59% | Renda Fixa | 0,65% | 5% | 3% | 5% PL Cota Sênior | 20% | Art. 7º, Inciso V, Alínea "A" |
| BVA FFPREV Migr | Multisetorial Master II - 11.989.256/0001-90 | Fechado | Fechado | 28.169,32 | 0,00% | -43,87% | | | | | | do CDI | 657.285,23 | 4,29% | | | | | | | |
| Trend Bank FFPREV Migr | Senior Multisetorial - 08.927.488/0001-09 | Fechado | Fechado | 0,01 | 0,00% | | | | | | | do CDI | 0,01 | | | | | | | | |
| Fundos de Renda Fixa com sufixo 'Crédito Privado' - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B" | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Renda Fixa | 0,00% | 5% | 0% | 5% | 20% | Art. 7º, Inciso V, Alínea "B" |
| Cotas de Fundo de Investimento - Lei 12.431 - com 85% do PL aplicado em Debêntures Incentivadas - Art. 7º, Inciso V, Alínea C | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Renda Fixa | 0,00% | 5% | 0% | 5% | 20% | Art. 7º, Inciso V, Alínea C |
| INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL ART. 8º + INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS ART. 10º + FUNDOS IMOBILIÁRIOS ART. 11º | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL ART. 8º + INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS ART. 10º + FUNDOS IMOBILIÁRIOS ART. 11º | | | | 444.145.636,09 | 30,01% | | | | | | | | | | | 30,01% | | | | | |
| INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL ART. 8º | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Fundo de Ações em Geral - CVM - Art. 8º, Inciso I | | | | 283.590.167,90 | 19,16% | | | | | | | | | | | 19,16% | | | | | |
| ARX Investimentos FFPREV Migr | ARX Income Instit FIC FIA - 38.027.169/0001-08 | D+1 | D+3 | 32.117.899,83 | 2,17% | 3,55% | | | | | | do IBOV | 804.006.245,60 | 3,99% | Renda Variável | 19,16% | 35% | 25% | 15% | 20% | Artigo 8º, Inciso I |
| AZQUEST FFPREV | FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89 | D+1 | D+3 | 9.971.729,03 | 0,67% | 4,55% | | | | | | do IBOV | 313.170.867,31 | 3,2% | | | | | | | |
| AZQUEST FFPREV | FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72 | D+27 | D+29 | 39.956.356,05 | 2,70% | 3,78% | | | | | | do SMLL | 1.538.685.373,47 | 2,6% | | | | | | | |
| AZQUEST FFPREV | SMALL MID CAPS RPPS FIC FIA - 34.791.108/0001-61 | D+27 | D+29 | 8.713.741,40 | 0,59% | 3,78% | | | | | | do SMLL | 1.538.685.373,47 | 0,6% | | | | | | | |
| Bco do Brasil FFPREV | BB Agro FIC FI - 40.054.357/0001-77 | D+0 | D+4 | 9.011.527,74 | 0,61% | 3,28% | | | | | | do IBOV | 454.547.332,55 | 1,98% | | | | | | | |
| BTG Pactual FFPREV | ABSOLUTO INS FIC FIA CNPJ: 11.977.794/0001-64 | D+30 | D+32 | 1.685.162,66 | 0,11% | 8,51% | | | | | | do IBOV | 1.409.026.324,92 | 0,12% | | | | | | | |
| CEF/Vinci Partner's FFPREV | FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15 | D+30 | D+32 | 14.170.592,75 | 0,96% | 3,36% | | | | | | do IDIV | 908.139.368,81 | 1,56% | | | | | | | |
| CEFederal FFPREV | FIC ACOES VALOR RPPS CNPJ: 14.507.699/0001-95 | D+21 | D+23 | 31.628.385,71 | 2,14% | 4,88% | | | | | | do IBOV | 655.001.608,72 | 4,83% | | | | | | | |
| ICATU FFPREV | Icatu Vang Dividendos FIA 08.279.304/0001-41 | D+1 | D+3 | 8.210.323,39 | 0,55% | 3,85% | | | | | | do IDIV | 913.956.760,51 | 0,90% | | | | | | | |
| ITAÚ FFPREV Migr | FIA Ações Dividendos - 02.887.290/0001-62 | D+1 | D+2 | 13.470.106,97 | 0,91% | 2,55% | | | | | | do IDIV | 264.891.899,71 | 5,09% | | | | | | | |
| ITAÚ FFPREV | Instit Ações Dunamis FIC FIA - 24.571.992/0001-75 | D+21 | D+23 | 27.501.975,23 | 1,86% | 6,01% | | | | | | do IBOV | 2.427.382.604,51 | 1,13% | | | | | | | |
| ITAÚ FFPREV Migr | Itaú RPI Ações Ibov FICFI - 08.817.414/0001-10 | D+2 | D+4 | 6.139.158,20 | 0,41% | 5,09% | | | | | | do IBOV | 566.032.083,96 | 1,08% | | | | | | | |
| ITAÚ FFPREV | Instit Ações Phoenix FIA - 23.731.629/0001-07 | D+21 | D+24 | 23.385.594,45 | 1,58% | 6,11% | | | | | | do IBOV | 553.337.313,47 | 4,23% | | | | | | | |
| MOAT FFPREV | Moat Capital Advisory FIC FIA CNPJ: 35.354.967/0001-56 | D+15 | D+17 | 26.514.047,98 | 1,79% | 9,17% | | | | | | do IBOV | 2.335.475.357,94 | 1,14% | | | | | | | |
| OCCAN FFPREV | OCCAM FIC FIA CNPJ 11.628.883/0001-03 | D+15 | D+17 | 12.712.336,63 | 0,86% | 3,41% | | | | | | do IBOV | 996.020.408,79 | 1,28% | | | | | | | |
| TARPON GT 30 FIC FIA FFPREV | TARPON GT 30 FIC FIA - 35.726.741/0001-39 | D+1 | D+32 | 8.365.729,01 | 0,57% | 9,67% | | | | | | do IBOV | 1.085.261.572,86 | 0,77% | | | | | | | |
| Vinci Partner's FFPREV Migr | Vinci Mosaico FIA, CNPJ 28.470.587/0001-11 | D+30 | D+32 | 3.695.207,79 | 0,25% | 4,59% | | | | | | do IBOV | 834.980.605,48 | 0,44% | | | | | | | |
| XP Investimentos FFPREV | XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12 | D+1 | D+3 | 6.340.293,08 | 0,43% | 6,63% | | | | | | do IDIV | 252.198.817,23 | 2,51% | | | | | | | |
| Fundo de Índice - ETF Renda variável - CVM - Art. 8º, Inciso II | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Renda Variável | 0,00% | 35% | 35% | 15% | 20% | Art. 8º, Inciso II |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR ART. 9º | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa - Investimentos no Exterior - Art. 9º, Inciso I | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | IE | 0,00% | 10% | 0% | 15% | 20% | Art. 9º, Inciso I |
| Fundo de Investimentos em Cotas - FIC - Art. 9º, Inciso II | | | | 75.235.202,52 | 5,08% | | | | | | | | | | | 5,08% | | | | | |
| Bco do Brasil/JP Morgan FFPREV | BB MM GLOBAL SELECT - 17.413.636/0001-68 | D+1 | D+6 | 19.141.981,43 | 1,29% | 7,73% | | | | | | MCSI World | 1.362.669.819,40 | 1,4% | IE | 5,08% | 10% | 10% | 15% | 20% | Art. 9º, Inciso II |
| Western Asset FFPREV | LEGG MASON - CNPJ: 28.320.600/0001-56 | D+1 | D+6 | 12.821.627,60 | 0,87% | 12,04% | | | | | | Russel 1000 | 169.168.864,98 | 7,58% | | | | | | | |
| XP Inv/Morgan Stanley | MS GLOBAL OPP FIC FIA IE - CNPJ 33.913.562/0001-85 | D+1 | D+6 | 19.017.978,04 | 1,29% | 11,73% | | | | | | MCSI World | 622.030.531,24 | 3,06% | | | | | | | |
| XP / Neuberger Berman FFPREV | Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Dólar - CNPJ 2[illegible] | D+1 | D+668 | 4.206.550,04 | 0,28% | 8,67% | | | | | | MCSI World | 116.880.324,42 | 3,60% | | | | | | | |
| SANTANDER FFPREV | GLOBAL EQUITIES IE CNPJ: 17.804.792/0001-50 | D+1 | D+8 | 14.812.337,72 | 1,00% | 6,78% | | | | | | MCSI World | 1.161.561.395,32 | 1,28% | | | | | | | |
| SCHRODER FFPREV | ACOES GLOBAIS - IE CNPJ: 37.308.394/0001-50 | D+1 | D+4 | 5.234.727,69 | 0,35% | 7,67% | | | | | | MCSI World | 286.089.629,20 | 1,83% | | | | | | | |
| Fundo de Ações - BDR Nível 1s - FIC - Art. 9º, Inciso III | | | | 24.637.386,32 | 1,66% | | | | | | | | | | | 1,66% | | | | | Art. 9º, Inciso III |
| Western Asset FFPREV | AÇÕES BDR NÍVEL I - CNPJ: 19.831.126/0001-36 | D+1 | D+6 | 24.637.386,32 | 1,66% | 10,42% | | | | | | NA | 1.967.815.796,47 | 1,25% | Ações Inv Ext | 1,66% | 10% | 10% | 15% | 20% | |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS ART. 10º | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Fundo de Investimentos em Multimercado Art. 10º, Inciso I | | | | 96.103.174,81 | 6,49% | | | | | | | | | | | 6,49% | | | | | |
| CEFederal FFPREV Venc. 01/07/2022 | Cap Prot Bolsa III Multim CNPJ 18.007.358/0001-01 | D+0 | D+668 | 0,00 | 0,00% | 0,24% | | | | | | do IBOV | 47.915.994,20 | 0,00% | Inv. Estruturados | 6,49% | 10% | 10% | 15% | 20% | Artigo 10º, Inciso I |
| CEFederal FFPREV Venc. 02/01/2024 | Cap Prot Bolsa IV Multim CNPJ 44.683.343/0001-73 | D+0 | D+750 | 14.634.144,54 | 0,99% | 0,79% | | | | | | do IBOV | 113.675.408,29 | 12,87% | | | | | | | |
| CEFederal FFPREV Venc. 01/07/2024 | Cap Prot Bolsa V Multim CNPJ 45.443.651/0001-94 | D+0 | D+750 | 4.904.454,58 | 0,33% | 0,09% | | | | | | do IBOV | 160.388.717,12 | 3,06% | | | | | | | |
| Mongeral Aegon FFPREV | MAG Strategy FIM CNPJ 41.687.144/0001-45 | D+0 | D+1 | 11.356.639,85 | 0,77% | 0,67% | | | | | | do CDI | 104.690.369,81 | 10,85% | | | | | | | |
| Western Asset FFPREV | WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48 | D+0 | D+1 | 38.641.462,45 | 2,61% | 10,11% | | | | | | do IBOV | 1.386.235.989,83 | 2,79% | | | | | | | |
| RIO BRAVO FFPREV | RIO BRAVO PROTECAO FIM - 42.813.674/0001-55 | D+1 | D+752 | 12.654.212,09 | 0,86% | 1,54% | | | | | | NA | 122.731.667,21 | 10,31% | | | | | | | |
| RIO BRAVO FFPREV | RIO BRAVO PROTECAO II FIM - 44.602.982/0001-67 | D+1 | D+752 | 13.912.261,30 | 0,94% | -2,79% | | | | | | NA | 155.972.117,32 | 8,92% | | | | | | | |
| Fundo de Investimentos em Participação Art. 10º, Inciso II | | | | 56.291.317,57 | 3,80% | | | | | | | | | | | 3,80% | | | | | |
| BRZ Brasil Portos FFPREV Migr | FIP Portos CNPJ 14.737.553/0001-36 | Fechado | Fechado | 393.065,13 | 0,03% | -2,78% | | | | | | do IPCA | 176.723.705,82 | 0,22% | Inv. Estruturados | 3,80% | 5% | 5% | 15% | 20% | Art. 10º Inciso II |
| BTG Pactual FFPREV | EconReal FIP Multiestrat CNPJ 35.640.811/0001-31 | Fechado | Fechado | 17.769.621,00 | 1,20% | -15,14% | | | | | | do IPCA | 2.556.476.338,04 | 0,70% | | | | | | | |
| BTG Pactual FFPREV Migr | FIP Infraestr II CNPJ 14.584.094/0001-06 | Fechado | Fechado | 233.809,64 | 0,02% | 0,34% | | | | | | do IPCA | 59.044.720,54 | 0,40% | | | | | | | |
| BTG Pactual FFPREV | Inv. de Impacto - FIP Multiestratégia CNPJ 36.642.497/0001-[illegible] | Fechado | Fechado | 4.663.252,00 | 0,32% | -0,17% | | | | | | do IPCA | 175.046.804,71 | 2,66% | | | | | | | |
| Kinea II FFPREV Migr | FIP CNPJ 16.437.148/0001-28 | Fechado | Fechado | 2.084.825,42 | 0,14% | 0,84% | | | | | | do IPCA | 14.802.260,61 | 14,08% | | | | | | | |
| Kinea IV Feeder FFPREV | FIP CNPJ 27.782.774/0001-78 | Fechado | Fechado | 21.266.800,68 | 1,44% | 0,64% | | | | | | do IPCA | 1.740.108.994,91 | #VALOR! | | | | | | | |
| Kinea V Feeder FFPREV | FIP CNPJ 41.745.796/0001-99 | Fechado | Fechado | 283.580,15 | 0,02% | -1,67% | | | | | | do IPCA | 203.703.473,45 | 0,14% | | | | | | | |
| Vinci Cap Partners III FFPREV | FIP Multiestratégia II CNPJ 30.507.217/0001-53 | Fechado | Fechado | 9.468.219,83 | 0,64% | 0,02% | | | | | | do IPCA | 247.651.370,66 | 3,82% | | | | | | | |
| Vinci Strategic Partners I FIP ME FFPREV | FIP Multiestratégia CNPJ 42.120.193/0001-64 | Fechado | Fechado | 128.143,72 | 0,01% | -1,58% | | | | | | do IPCA | 6.003.736,79 | 2,13% | | | | | | | |
| Fundo de Ações - Mercado de Acesso Art. 10º, Inciso III | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Inv. Estruturados | 0,00% | 5% | 0% | 15% | 20% | Art. 10º Inciso III |
| FUNDOS IMOBILIÁRIOS ART. 11º | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Fundo de Investimento Imobiliário Art. 11º | | | | 8.160.975,81 | 0,55% | | | | | | | | | | | 0,55% | | | | | |
| RB Capital FFPREV Migr | FII Renda II - 09.006.914/0001-34 (107.933 quotas) | Fechado | Fechado | 4.162.975,81 | 0,28% | 1,62% | | | | | | do IFIX | 71.423.386,02 | 5,83% | Imobiliário | 0,55% | 5% | 1% | 15% | 20% | Art. 11º |
| Reag Renda Imob FFPREV Migr | REAG FII - 17.374.696/0001-19 ( 10.000 quotas) | Fechado | Fechado | 3.998.000,00 | 0,27% | 20,52% | | | | | | do IFIX | 97.703.124,00 | 4,09% | | | | | | | |
| EMPRÉSTIMO CONSIGNADO ART. 12º | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| EMPRÉSTIMO CONSIGNADO ART. 12º | | | | 0,00 | 0,00% | | | | | | | | | | Consignado | 0,00% | 10% | 10% | - | - | Art. 12º |
| Disponibilidade de Caixa | | | | 180.637,09 | 0,01% | | | | | | | | | | | 0,01% | | | | | |
| Disponibilidade em Caixa FFPREV (Santander+CEF) | | | | 180.637,09 | | | | | | | | | | | Disponibilid. | 0,01% | | | | | |
| TOTAL DE ATIVOS | | | | 1.479.836.130,08 | 100,00% | | | | | | | | | | | 100,00% | | 1,68% | | | |

| | |
|---|---|
| Meta Atuarial( INPC+4,00%aa)+(-) 0,60 +0,327374) | -0,27% |
| Rentabilidade no mês SBCPREV FFPREV | 1,05% |
| INPC | -0,60% |
| CDI | 1,03% |
| IPCA | -0,68% |

| | |
|---|---|
| FFPREV - Ano | -0,67% |
| Meta Atuarial - Ano | 7,37% |
| FFPREV - 12 meses | -2,49% |
| Meta Atuarial - 12 Meses | 14,52% |
| | 1.479.836.130,08 |
| | **1.479.836.130,08** |

**CARTEIRA DE INVESTIMENTO**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| Renda Fixa | rentabilidade no mês | -0,85% | 935.637.268,06 | 63,23% |
| Renda Variável + Estruturados + FII | rentabilidade no mês | 3,42% | 444.145.636,09 | 30,01% |
| Exterior | rentabilidade no mês | 9,57% | 99.872.588,84 | 6,75% |
| Consignados | | | 0,00 | 0,00% |
| Total dos Investimentos | | | 1.479.655.492,99 | |
| Disponibilidade Caixa | | | 180.637,09 | 0,01% |
| Total Geral | | 1,05% | 1.479.836.130,08 | 100,00% |

| FFPREV Julho 2022 | 1.479.836.130,08 | 100,00% | Lim Resol 100,00% |
|---|---|---|---|
| **RENDA FIXA ART. 7º** | 935.637.268,06 | 63,23% | 100,00% |
| Carteira Própria - Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso I, Alínea A | 427.648.391,64 | 28,90% | 100,00% |
| FI Renda Fixa que contenham 100% TP do TN- Art. 7º, Inciso I, Alínea B | 359.686.602,87 | 24,31% | 100,00% |
| Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C | 0,00 | 0,00% | 100,00% |
| Operações Compromissadas com Lastro em TPF - Art. 7º, Inciso | 0,00 | 0,00% | 5,00% |
| Fundos de Renda Fixa conforme CVM Art. 7º, Inciso III, Alínea A | 138.675.535,90 | 9,37% | 65,00% |
| Fundos de Índice ETF - Conforme CVM - Art. 7º, Inciso III, Alíne | 0,00 | 0,00% | 65,00% |
| Ativos Financeiros de RF de emissão com obrigação ou coobrigação de Inst. Financeiras Bancárias autorizadas pelo BACEN-CDB. LFT. etc. - Art. 7º. Inciso IV | 0,00 | 0,00% | 20,00% |
| Fundos de Investimentos em Direitos Creditóios - FIDC Cota Sênior - Art. 7º, Inciso V, Alínea A | 9.626.737,65 | 0,65% | 5,00% |
| Fundos de Renda Fixa com sufixo 'Crédito Privado' - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B" | 0,00 | 0,00% | 5,00% |
| Cotas de Fundo de Investimento - Lei 12.431 - com 85% do PL aplicado em Debêntures Incentivadas - Art. 7º, Inciso V, Alínea C | 0,00 | 0,00% | 5,00% |
| **RENDA VARIÁVEL ART. 8º** | 283.590.167,90 | 19,16% | 30,00% |
| Fundo de Ações em Geral - CVM - Art. 8º, Inciso I | 283.590.167,90 | 19,16% | 35,00% |
| Fundo de Índice - ETF Renda variável - CVM - Art. 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00% | 35,00% |
| **INVESTIMENTOS NO EXTERIOR ART. 9º** | 99.872.588,84 | 6,75% | 10,00% |
| Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa - Investimentos no Exterior - Art. 9º. Inciso I | 0,00 | 0,00% | 10,00% |
| Fundo de Investimentos em Cotas - FIC - Art. 9º, Inciso II | 75.235.202,52 | 5,08% | 10,00% |
| Fundo de Ações - BDR Nível 1s - FIC - Art. 9º, Inciso III | 24.637.386,32 | 1,66% | 10,00% |
| **INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS ART. 10º** | 152.394.492,38 | 10,30% | 15,00% |
| Fundo de Investimentos em Multimercado Art. 10º, Inciso I | 96.103.174,81 | 6,49% | 10,00% |
| Fundo de Investimentos em Participação Art. 10º, Inciso II | 56.291.317,57 | 3,80% | 5,00% |
| Fundo de Ações - Mercado de Acesso Art. 10º, Inciso III | 0,00 | 0,00% | 5,00% |
| **FUNDOS IMOBILIÁRIOS ART. 11º** | 8.160.975,81 | 0,55% | 5,00% |
| Fundo de Investimentos Imobiliário Art. 11º | 8.160.975,81 | 0,55% | 5,00% |
| **EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS ART. 12º** | 0,00 | 0,00% | 5,00% |
| Emprestimos Consignados Art. 12º | 0,00 | 0,00% | 10,00% |
| Disponibilidade de Caixa | 180.637,09 | 0,01% | 0,00% |

**CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**

| | | |
|---|---|---|
| Títulos Públicos | 427.648.391,64 | 28,90% |
| CEFederal | 113.951.809,37 | 7,70% |
| Banco do Brasil | 158.995.719,46 | 10,74% |
| Santander | 145.046.105,99 | 9,80% |
| Western | 86.093.328,29 | 5,82% |
| Itaú | 80.532.304,52 | 5,44% |
| AZQuest | 58.641.826,48 | 3,96% |
| Bradesco | 53.645.737,16 | 3,63% |
| Icatu Vanguard | 38.711.725,19 | 2,62% |
| ARX Investimentos | 32.117.899,83 | 2,17% |
| XP Investimentos | 29.564.821,16 | 2,00% |
| Moat | 26.514.047,98 | 1,79% |
| Kinea/Itau | 23.635.206,25 | 1,60% |
| BTG Pactual | 24.351.845,30 | 1,65% |
| Safra | 21.090.862,15 | 1,43% |
| Vinci Partner's/CEF | 45.798.978,46 | 3,09% |
| Sul América | 15.024.641,97 | 1,02% |
| Occan | 12.712.336,63 | 0,86% |
| Rio Bravo | 26.566.473,39 | 1,80% |
| Ourinvest | 9.598.568,32 | 0,65% |
| Mongeral Aegon | 13.938.625,14 | 0,94% |
| Tarpon | 8.365.729,01 | 0,57% |
| Vinci Partner's | 13.291.571,34 | 0,90% |
| SCHRODER | 5.234.727,69 | 0,35% |
| RBCapital | 4.162.975,81 | 0,28% |
| Reag | 3.998.000,00 | 0,27% |
| Perfin | 0,00 | 0,00% |
| BRZ | 393.065,13 | 0,03% |
| BVA | 28.169,32 | 0,00% |
| TrendBank | 0,01 | 0,00% |
| Saldo Caixa | 180.637,09 | 0,01% |
| **TOTAL** | **1.479.836.130,08** | **100,00%** |

**RENDA FIXA**

| | % do total | | % da Rfixa |
|---|---|---|---|
| Títulos Públicos | 28,90% | 427.648.391,64 | 45,71% |
| IMA-B | 8,58% | 127.001.927,14 | 13,57% |
| IMA-B5 | 14,77% | 218.522.637,53 | 23,36% |
| IMA-B5 - ATIVO | 0,68% | 9.992.851,92 | 1,07% |
| Alocação Dinâmica | 4,13% | 61.177.430,39 | 6,54% |
| IRF-M | 2,64% | 39.042.672,35 | 4,17% |
| DI + Outros R Fixa | 0,20% | 3.000.000,00 | 0,32% |
| FIDC | 0,65% | 9.626.737,65 | 1,03% |
| IPCA | 2,68% | 39.624.619,44 | 4,24% |
| **Total** | *63,23%* | *935.637.268,06* | *100,00%* |

**RENDA VARIÁVEL**

| | | | % da Rvariável |
|---|---|---|---|
| Ações em Geral 8-I | 19,16% | 283.590.167,90 | 100,00% |
| ETF Ações 8-II | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| **Total** | 19,16% | 283.590.167,90 | 100,00% |

**INVESTIMENTOS NO EXTERIOR**

| | % do total | | % dos IE |
|---|---|---|---|
| Renda Fixa -Dívida Externa - 9-I | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| FIC 9-II | 5,08% | 75.235.202,52 | 75,33% |
| Ações BDR-Nível 1 - 9-III | 1,66% | 24.637.386,32 | 24,67% |
| **Total** | 6,75% | 99.872.588,84 | 100,00% |

**INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

| | % do total | | % dos Inv. Estruturados |
|---|---|---|---|
| Multimercado 10-I | 6,49% | 96.103.174,81 | 63,06% |
| FIP 10-II | 3,80% | 56.291.317,57 | 36,94% |
| Ações - Mercado de Acesso 10-III | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| **Total** | 10,30% | 152.394.492,38 | 100,00% |

**FUNDOS IMOBILIÁRIOS**

| | % do total | | % Dos FIIs |
|---|---|---|---|
| FI Imobiliário 11 | 0,55% | 8.160.975,81 | 100,00% |
| **Total** | 0,55% | 8.160.975,81 | 100,00% |

**Empréstimos Consignados**

| | | | % Dos Consignados |
|---|---|---|---|
| Emp. Consignados 12 | 0,00% | 0,00 | |
| **Total** | | 0,00 | 0,00% |
| | 0,00% | | |
| Disponibilidade Financeira | 0,01% | 180.637,09 | |
| **TOTAL** | 100,00% | 1.479.836.130,08 | |