



SBCPREV

"SUA PREVIDÊNCIA AINDA MAIS FORTE"

SBC PREV APRESENTAÇÃO FINANCEIRA



1º CICLO DE PALESTRAS
26/11/2013

Competências e Responsabilidades da Diretoria Administrativa e Financeira

Tesouraria

Pagamentos /
Recebimentos
Aplicações / Resgates
Controles bancários
diversos

Contabilidade

Processos / peças
orçamentárias
Controles fiscais
Auditoria TCE

Serviços

Suporte Administrativo
Informática
Licitações

DIRETORIA

Gestão
Financeiro-
Contábil

Controladoria

Ordens de pagamento
Liquidações / Processos
e controle contábeis

Execução da
política de
Investimentos

a) Segregação de Massa;

b) Separação dos Fundos;

c) Autonomia administrativa, financeira e patrimonial;

d) Parcelamento e Re-parcelamento das dívidas da PMSBC com ao SBCPrev;

e) Instituição da contribuição para cobertura do Déficit Técnico Atuarial.

Segregação de Massa

Admitidos até 30/09/2011

Ativos FFIN1 Set/2013 = 8.770

Inativos FFIN1 Set/2013 = 6.932

Total Ativos/Inativos = 15.702

Admitidos após 30/09/2011

Ativos FFPREV Set/2013 = 1.617

Separação dos Fundos

**Fundo 1 (FFIN1) – Financeiro
admitidos até 30/09/2011 (fluxo de caixa)**

**Fundo 2 (FFIN2) – Financeiro
admitidos até 30/09/2011
(saldo FUPREM blindado até 2045)**

**Fundo Previdenciário (FFPREV) –
Capitalização
(admitidos após 01/10/2011)**



FFIN1

Fluxo de Caixa - FFIN1

PAGAMENTO DE APOSENTADOS E PENSIONISTAS: Arrecadação em Set/2013

9.623.000,	11% ativos e 22% patronal	= R\$
446.000,	Inativos	= R\$
4.240.000,	Comprev	= R\$
<u>14.309.000,</u>	Total arrecadação	<u>R\$</u>

Despesas Folha Pagamento Aposentados e Pensionistas
Fopag Set/2013 **R\$ 21.800.000,**

Diferença FaltanteR\$ 7.491.000,

FFIN 2

Fundo Blindado - FFIN 2

Valor recebido do FUPREM
Recebido do parcelamento de dívidas;
Contribuição do déficit técnico Atuarial;
Rendimentos (positivos e negativos) dos investimentos financeiros;

FFIN2 em 01/10/2011 – Transf.FUPREM
R\$ 305.199.487,23

Saldo FFIN2 em 31/12/2012
R\$ 402.675.061,47

Saldo FFIN2 em 30/09/2013
R\$ 390.109.390,89

NOTA

Houve evolução de **32%** em 2012 com relação a 2011 e **INVOLUÇÃO** de **(-3,12%)** em 30/09/2013 com relação a 2012.

Isso demonstra a enorme volatilidade no mercado financeiro e de capitais em 2013, onde o Rendimento do IMA-B, principal índice de Renda Fixa está **NEGATIVO** em **(-8,70 %)** e o IBOVESPA, principal indicativo de Renda Variável, está **NEGATIVO** em **(14,13%)**.



FFPREV

Admitidos a partir de 01/10/2011 FFPREV

Saldo em 01/10/2011
R\$ Zero

Saldo em 31/12/2012
R\$ 7.979.755,17

Saldo em 30/09/2013
R\$ 14.108.864,73

Verifica-se uma evolução importante no Fundo Previdenciário, salientando que o mesmo vem sofrendo também com a volatilidade no mercado.

Entretanto, não ocorrem pagamentos atualmente, porque somente quando um grupo servidores admitidos a partir de Set/2011 se aposentar é que começará haver resgates nesse Fundo.

Características e Composição dos Fundos



CARACTERÍSTICAS DE INVESTIMENTOS

RENDA FIXA:

- IMA-B - TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS
- FIDC – CRÉDITO PRIVADO – ABERTO E FECHADO
 - FUNDO REFERENCIADO DI

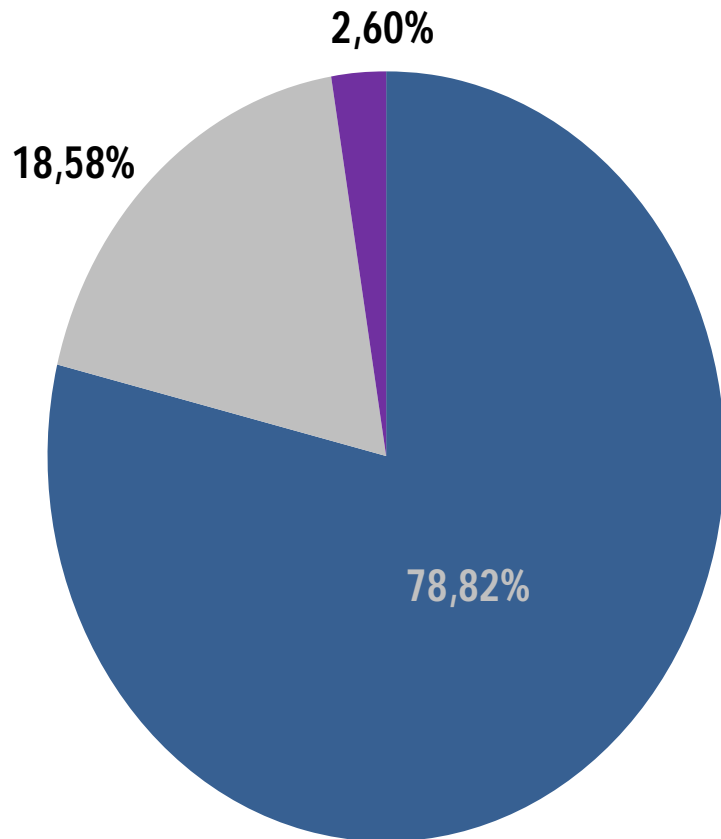
RENDA VARIÁVEL :

- FUNDO DE AÇÕES
- FUNDO DE AÇÕES REFERENCIADOS, DIVIDENDOS, SMALL CAP
- FUNDO MULTIMERCADO

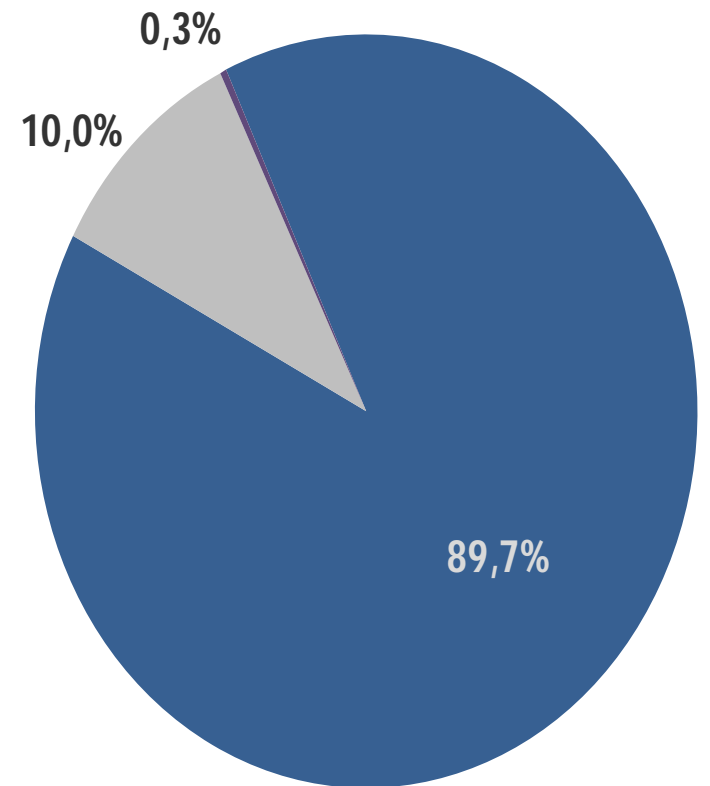
RENDA VARIÁVEL -ESTRUTURADOS:

- FUNDOS IMOBILIÁRIOS-FII
- FUNDO DE INVESTIMENTOS E PARTICIPAÇÕES-FIP

COMPOSIÇÃO E MIX DE INVESTIMENTOS



SBCPREV



AMOSTRA

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

GESTOR DE ATIVOS SBCPrev DEVE POSSUIR ELEVADA CAPACITAÇÃO TÉCNICA, AMPLA EXPERIÊNCIA E ATUAÇÃO NO MERCADO FINANCEIRO E CERTIFICAÇÃO CPA 10

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS ANUAL SBCPrev É FUNDAMENTADA NA RESOLUÇÃO CVM 3922/2010 E LEI 6145/2011, APROVADA PELO CONSELHO ADMINISTRATIVO, VISANDO:

BUSCA E MANUTENÇÃO DO EQUILÍBRIO FINANCEIRO E ATUARIAL (INPC+6% a.a.);

BUSCA DE RISCOS ADEQUADOS AO PERFIL SBCPrev , TAXA DE RETORNO ESPERADA, LIQUIDEZ ADEQUADA DOS ATIVOS E LIMITES LEGAIS E OPERACIONAIS ;

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DE INVESTIMENTO (Máximo de 25% dos PL do SBCPrev numa mesma Instituição Financeira);

INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS PARA INVESTIMENTO DEVEM GERIR PATRIMÔNIO LÍQUIDO SUPERIOR A **RS 1,5 BILHÃO, TER RECONHECIDA CAPACIDADE TÉCNICA, TRADIÇÃO DE MERCADO E COMPLIANCE NA GESTÃO DE RECURSOS;**

INVESTIMENTOS SÃO CARACTERÍSTICOS PARA MÉDIO E LONGO PRAZOS;

INVESTIMENTOS SÃO EFETUADOS CONSULTIVA E DELIBERATIVAMENTE COM COMITÊ DE INVESTIMENTOS E OS LIMITES CONTROLADOS PELO MPS, ACOMPANHADO PELA EMPRESA DE CONSULTORIA FINANCEIRA (RISK OFFICE).

BANCOS

Liquidados ou Sob Intervenção



BANCO SANTOS



FUNDO SANTOS CREDIT YELD FIF

**APLICADOR
FUPREM**

**FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA DE CRÉDITO PRIVADO (18/10/2002)
CREDITOS CONCEDIDOS PELO BANCO SANTOS À DIVERSAS EMPRESAS**

**APLICADO – 2004
R\$ 4.800.000,00**

**RESGATADO - 2004
R\$ 3.000.000,00**

**VALOR DO SALDO R\$ 2.081.405,52
BAIXADO NO BALANÇO DE 24/10/2005, COMO DESPESA E PROVISÃO PARA PERDAS**

12/11/2004	BACEN INTERVEM BANCO SANTOS/SANTOS CORRETORA CÂMBIO E VALORES
04/05/2005	BACEN DECRETA LIQUIDAÇÃO EXTRAJUDICIAL
09/05/2005	CVM NOMEIA BNY MELLON COMO ADMINISTRADORA
20/09/2005	DECRETADA FALÊNCIA BANCO SANTOS
	VALOR PROVISIONADO EM 29/10/2005 R\$ 2.081.405,52 E RECEBIDO ATÉ 30/09/2013 R\$ 814.870,66, RESTANDO A RECEBER R\$ 1.266.534,86

BANCO SANTOS

ANÁLISE DE INVESTIMENTO SOB DEMANDA						
INSTITUIÇÃO:	BANCO SANTOS					
APLICADOR	FUPREM					
FUNDO:	SANTOS CREDIT YELD FIF – CNPJ: 04.877.280/0001-71					
CARACTERÍSTICAS:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA DE CRÉDITO PRIVADO (18/10/2002), CREDITOS CONCEDIDOS PELO BANCO SANTOS À DIVERSAS EMPRESAS					
INVESTIMENTO (R\$):	DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	SALDO	RENDIMENTO	DIFERENÇA
	14/05/2004	3.000.000,00				
	07/06/2004	1.300.000,00				
	10/08/2004	500.000,00				
	27/08/2004		1.500.000,00		71.695,28	
	29/09/2004		500.000,07		31.207,79	
	26/10/2004		1.000.000,00		74.786,11	
	Subtotal	4.800.000,00	3.000.000,00	1.800.000,00	177.698,18	
	11/11/2004			2.093.261,35		
HISTÓRICO:	DATA	OCORRÊNCIAS				
	12/11/2004	BACEN INTERVEEM NO BANCO SANTOS E SANTOS CORRETORA DE CÂMBIO E VALORES				
	04/05/2005	BACEN DECRETA LIQUIDAÇÃO EXTRAJUDICIAL				
	09/05/2005	CVM NOMEIA BNY MELLON COMO ADMINISTRADORA				
	22/05/2005	ASSEMBLÉIA GERAL RATIFICA NOMEAÇÃO ADMINISTRADORA				
	25/08/2005	OCORRE A 1ª. LIBERAÇÃO DE R\$ 63.199,92				
	20/09/2005	DECRETADA FALÊNCIA BANCO SANTOS				
	29/10/2005	VALOR DO SALDO R\$ 2.081.405,52 (1.397.649,655 COTAS) BAIXADO NO BALANÇO DE 24/10/2005, COMO DESPESA E PROVISÃO PARA PERDAS				
		VALOR PROVISIONADO EM 29/10/2005 R\$ 2.081.405,52 E RECEBIDO ATÉ 30/09/2013 R\$ 814.870,66 , RESTANDO A RECEBER R\$ 1.266.534,86				
CONCLUSÃO:	PARECER E NOTAS					
05/11/2013	SBCPREV PARTICIPOU DA AGE DE 24/07/2013 E DA APRESENTAÇÃO DO RELATÓRIO DAS NEGOCIAÇÕES EXTRAJUDICIAIS E JUDICIAIS NO ÂMBITO DO RECEBIMENTO DOS CRÉDITOS					



**BANCO
CRUZEIRO DO SUL**

**APLICADOR
FUPREM**

FIDC ABERTO BCSUL VERAX CPP360

**CRÉDITO CONSIGNADO PARA SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS,
ESTADUAIS E FEDERAIS CARÊNCIA PARA RESGATE: 60 DIAS**

APLICADO – 2008 R\$ 7.000.000,00
SALDO Intervenção - R\$ 11.011.877,22

RESGATADO – até 10/2013
R\$ 3.986.584,99

**27/06/2012 - COMECARAM OS RESGATES ATÉ 10/10/2013, NO TOTAL DE
R\$ 3.986.584,99, RESTANDO SALDO EM 30/09/2013 R\$ 8.129.807,04**

07/04/2012	TENDO VERIFICADO TENDÊNCIA DE POSSÍVEIS PROBLEMAS COM O BANCO CRUZEIRO DO SUL, O SBCPREV DECIDIU SOLICITAR OS RESGATES DE: R\$ 5.000.000,00 + R\$ DO TOTAL APLICADO
02/05/2012	
	EM RAZÃO DA CARÊNCIA DE RESGATE (60 DIAS), OS RESGATES SOLICITADOS NÃO TIVERAM SUCESSO, POIS O BACEN DECRETOU RAET EM 04/06/2012 E NOMEIA FGC COMO NOVO ADMINISTRADOR
14/09/2012	BACEN DECRETA LIQUIDAÇÃO EXTRAJUDICIAL DO BANCO CRUZEIRO DO SUL
27/06/2012	COM A INTERVENÇÃO DO BACEN, O FUNDO FOI FECHADO E COLOCADO “EM LIQUIDAÇÃO” A PARTIR DESTA DATA, INICIARAM-SE OS RESGATES MENSAIS, À MEDIDA QUE VÃO SENDO REALIZADOS OS RECEBIMENTOS DOS CRÉDITOS CONSIGNADOS, COM PREVISÃO DE TÉRMINO ENTRE 48 E 60 MESES

BANCO CRUZEIRO DO SUL

ANÁLISE DE INVESTIMENTO SOB DEMANDA						
INSTITUIÇÃO:	BANCO CRUZEIRO DO SUL					
APLICADOR	FUPREM					
FUNDO:	FIDC ABERTO BCSUL VERAX CPP360- CNPJ: 06.318.094/0001-28					
CARACTERÍSTICAS:	CRÉDITO CONSIGNADO PARA SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS, ESTADUAIS E FEDERAIS CARÊNCIA PARA RESGATE: 60 DIAS					
INVESTIMENTO (R\$):	DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	SALDO	RENDIMENTO	DIFERENÇA
	24/04/2008	2.000.000,00				
	14/05/2008	3.000.000,00				
	23/07/2008	2.000.000,00				
	25/11/2011			10.424.761,88(*)		3.424.761,88
	31/05/2012			11.011.877,22(**)		
	08/11/2013		4588112,90	8.136.876,57		
	Subtotal	7.000.000,00	4588112,90	8.136.876,57		
HISTÓRICO:	DATA	OCORRÊNCIAS				
		TENDO VERIFICADO TENDÊNCIA DE POSSÍVEIS PROBLEMAS COM O BANCO CRUZEIRO DO SUL, O SBCPREV DECIDIU SOLICITAR OS RESGATES ABAIXO:-				
	07/04/2012	R\$ 5.000.000,00				
	02/05/2012	R\$ DO TOTAL APLICADO				
		EM RAZÃO DA CARÊNCIA DE RESGATE (60 DIAS), OS RESGATES SOLICITADOS NÃO TIVERAM SUCESSO, POIS O BACEN DECRETOU RAET EM 04/06/2012				
	04/06/2012	BACEN DECRETA RAET E NOMEIA FGC COMO NOVO ADMINISTRADOR				
	14/09/2012	BACEN DECRETA LIQUIDAÇÃO EXTRAJUDICIAL DO BANCO CRUZEIRO DO SUL				
		DESCOBRIU-SE "FRAUDE" NA GERAÇÃO DOS CONSIGNADOS LIGADOS A UM CLUBE DE OFICIAIS DO EXÉRCITO, SENDO AS COTAS SUBORDINADAS SUFICIENTES PARA ABSORVER AS PERDAS				
		COTA SUBORDINADA CORRESPONDE ÀQUELA QUE SE SUBORDINA À COTA SENIOR PARA EFEITO DE AMORTIZAÇÃO E RESGATE É UMA ESPÉCIE DE GARANTIA PRESTADA PELO CEDENTE DOS DIREITOS CREDITÓRIOS E SERVE COMO UM COLCHÃO PARA ABSORVER INADIMPLÊNCIAS POR PARTE DO SACADOR E OUTRAS OCORRÊNCIAS QUE POSSAM IMPACTAR "NEGATIVAMENTE" O COTISTA SÊNIOR				
	27/06/2012	COM A INTERVENÇÃO DO BACEN, O FUNDO FOI FECHADO E COLOCADO "EM LIQUIDAÇÃO" A PARTIR DESTA DATA, INICIARAM-SE OS RESGATES MENSAIS, À MEDIDA QUE VÃO SENDO REALIZADOS OS RECEBIMENTOS DOS CRÉDITOS CONSIGNADOS, COM PREVISÃO DE TÉRMINO ENTRE 48 E 60 MESES				
	27/06/2012	COMEÇARAM OS RESGATES ATÉ 10/10/2013, NO TOTAL DE R\$ 3.986.584,99, RESTANDO SALDO EM 30/09/2013 DE APROXIMADAMENTE R\$ 8.136.876,57				
CONCLUSÃO:	PARECER E NOTAS					
14/11/2013	SBC PREV PARTICIPOU DA AGE EM 23/06/2012 E VEM ACOMPANHANDO O ANDAMENTO DOS RESGATES, QUE VEM CORRENDO MENSALMENTE, INTERROMPIDOS SOMENTE EM ABR/MAI/JUN-2013 PARA REALIZAÇÃO DE NOVA AUDITORIA					

BANCO BVA
**FIDC (Fechado) MULTISSETORIAL
BVA MASTER II**
**APLICADOR
FUPREM**

CRÉDITO À DIVERSAS EMPRESAS DE MIDLE MARKET ORIGINADOS NO BVA ATRAVÉS DE CCB, ONDE O TOMADOR RECEBE UM CRÉDITO MAIOR DO QUE O SOLICITADO, DEIXANDO NO BANCO UM CDB DE PARTE DO CRÉDITO. AS GARANTIAS NA MAIORIA DOS CCB SÃO IMÓVEIS. PRAZO: 07 MESES (CARÊNCIA) + 48 MESES AMORTIZAÇÃO PMP MENSAL - VENCIMENTO: 05/02/2015

APLICADO – ago/2010 R\$ 6.000.000,00
SALDO Intervenção - R\$ 2.615.607,90

RESGATADO – até 08/2013
R\$ 4.874.809,75

ENTRE DEZ/2012 E SET/2013, AS COTAS SE DESVALORIZARAM EM 98%, CAÍNDO DE R\$ 433,97 PARA R\$ 6,56 NO PERÍODO, REDUZINDO O SALDO R\$ 2.615.607,90 PARA R\$ 38.505,45 EM 30/09/2013

	EM MEADOS DE 2012 O SBCPREV VERIFICA QUE O BVA APRESENTA DIFICULDADES, MAS EM RAZÃO DE SE TRATAR DE FIDC “FECHADO”, NÃO EXISTE POSSIBILIDADE DE RESGATE ANTECIPADO.
19/10/2012	BACEN INTERVENÇÃO NO BANCO BVA
19/06/2013	BACEN DECRETA LIQUIDAÇÃO EXTRAJUDICIAL DO BANCO BVA
04/09/2013 10/2013	DEFINIDO NOVO GESTOR: BRASIL PLURAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA, QUE JÁ ESTÁ DE POSSE DOS CCB, TODOS EM COBRANÇA JUDICIAL, ATRAVÉS ESCRITÓRIO: PINHEIRO NETO ADVOGADOS ASSOCIADOS
23/10/2013	APROVADO E CONSTITUÍDO COMITÊ DE CRÉDITO PARA DELIBERAÇÃO DE ACORDOS COM DEVEDORES DO FUNDO.O GESTOR TEM PELA EXPERIÊNCIA, EXPECTATIVA DE RECEBIMENTO DE % ELEVADO EM RAZÃO DAS GARANTIAS

BANCO BVA

ANÁLISE DE INVESTIMENTO SOB DEMANDA						
INSTITUIÇÃO:	BANCO BVA					
APLICADOR	FUPREM					
FUNDO:	FIDC (Fechado) MULTISSETORIAL BVA MASTER II – CNPJ: 11.989.256/0001-90					
CARACTERÍSTICAS:	CRÉDITO À DIVERSAS EMPRESAS DE MIDDLE MARKET ORIGINADOS NO BVA ATRAVÉS DE CCB, ONDE O TOMADOR RECEBE UM CRÉDITO MAIOR DO QUE O SOLICITADO, DEIXANDO NO BANCO UM CDB DE PARTE DO CRÉDITO. AS GARANTIAS NA MAIORIA DOS CCB SÃO IMÓVEIS. PRAZO: 07 MESES (CARÊNCIA) + 48 MESES AMORTIZAÇÃO PMP MENSAL - VENCIMENTO: 05/02/2015					
INVESTIMENTO (R\$):	DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	SALDO	RENDIMENTO	DIFERENÇA
	08/2010	6.000.000,00				
	31/10/2012			2.615.607,90(*)		
	Até 05/08/2013		4.874.809,75			
	30/09/2013			38.505,45		
	Subtotal	6.000.000,00	4.874.809,75	38.505,45		1.152.190,25
HISTÓRICO:	DATA	OCORRÊNCIAS				
		EM MEADOS DE 2012 O SBCPREV VERIFICA QUE O BVA APRESENTA DIFICULDADES, MAS EM RAZÃO DE SE TRATAR DE FIDC "FECHADO", NÃO EXISTE POSSIBILIDADE DE RESGATE ANTECIPADO				
		HOUE INSISTÊNCIA MUITO GRANDE DOS GESTORES DO BVA PARA QUE O SBCPREV FIZESSE NOVOS APORTES NESSE E EM OUTROS FUNDOS, MAS ISTO FOI REJEITADO PELO COMITÊ DE INVESTIMENTOS				
		ENTRE DEZ/2012 E SET/2013, AS COTAS SE DESVALORIZARAM EM 98%, CAÍNDO DE R\$ 433,97 PARA R\$ 6,56 NO PERÍODO, REDUZINDO O SALDO DISPONÍVEL EM 30/09/2013 PARA R\$ 38.505,45				
	19/10/2012	BACEN INTERVENÇÃO NO BANCO BVA				
		HOUE DIFICULDADES PARA CONSEGUIR OS CCB JUNTO AO INTERVENTOR				
	19/06/2013	BACEN DECRETA LIQUIDAÇÃO EXTRAJUDICIAL DO BANCO BVA				
	04/09/2013	DEFINIDO NOVO GESTOR: BRASIL PLURAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA				
	10/2013	NOVO GESTOR JÁ ESTÁ DE POSSE DOS CCB, TODOS EM COBRANÇA JUDICIAL, ATRAVÉS DO ESCRITÓRIO: PINHEIRO NETO ADVOGADOS ASSOCIADOS				
	23/10/2013	APROVADO E CONSTITUÍDO COMITÊ DE CRÉDITO PARA DELIBERAÇÃO DE ACORDOS COM DEVEDORES DO FUNDO. O GESTOR TEM PELA EXPERIÊNCIA, EXPECTATIVA DE RECEBIMENTO DE % ELEVADO EM RAZÃO DAS GARANTIAS				
CONCLUSÃO:	PARECER E NOTAS					
05/11/2013	O SBCPREV VEM PARTICIPANDO ATIVAMENTE DE TODAS AS AGE E ACOMPANHANDO DE PERTO TODAS AS AÇÕES VINDO A RECUPERAÇÃO DO CAPITAL INVESTIDO					



BANCO TREND BANK

**APLICADOR
FUPREM**

**FIDC (FECHADO) TREND BANK
MULTISETORIAL**

**FIDC REFERENTE EMPRÉSTIMOS, DESCONTO DE DUPLICATAS E CHEQUES À
DIVERSAS EMPRESAS PRAZO: 10 ANOS, COM AMORTIZAÇÃO MENSAL DE JUROS**

**APLICADO – Dez/ 2010
R\$ 5.000.000,00**

**SALDO – até 09/2013 - R\$ 4.997.751,49
RENDIM → 10/2013 - R\$ 1.534.183,50**

**14/10/2013 PLANNER APRESENTA FATO RELEVANTE REFERENTE AO AUMENTO DA
INADIMPLÊNCIA E DESENQUADRAMENTO DE COTA SUBORDINADA E CONVOCA
ASSEMBLÉIA GERAL EXTRAORDINÁRIA PARA 24/10/2013**

**PRAZO: PRORROGADO PARA 15 ANOS – SALDO DA CARTEIRA: R\$ 400.205.667,70
INADIMPLÊNCIA DE: R\$ 111.839.428,76 (28%) EM 30/09/2013**

06/06/2013	ASSEMBLÉIA PRORROGA PRAZO DE RESGATE PARA MAIS 05 ANOS E ELEVA RENTABILIDADE PARA 140% DO CDI (SBCPREV VOTOU CONTRA)
24/10/2013	AGE DELIBERA PELA TROCA DA “GESTORA” E PEDE NOVA AGE EM 21/11/2013 PARA ADMINISTRADORA APRESENTAR PROPOSTA DE NOVOS GESTORES E A REAL SITUAÇÃO DA INADIMPLÊNCIA COM POSSÍVEIS MEDIDAS A SEREM ADOTADAS

BANCO TREND BANK

ANÁLISE DE INVESTIMENTO SOB DEMANDA						
INSTITUIÇÃO:	BANCO TREND BANK					
APLICADOR	FUPREM					
FUNDO:	FIDC (FECHADO) TREND BANK MULTISETORIAL – CNPJ: 08.927.488/0001-09					
CARACTERÍSTICAS:	FIDC REFERENTE EMPRÉSTIMOS, DESCONTO DE DUPLICATAS E CHEQUES À DIVERSAS EMPRESAS PRAZO: 10 ANOS, COM AMORTIZAÇÃO MENSAL DE JUROS					
INVESTIMENTO (R\$):	DATA	APLICAÇÃO	RESGATE	SALDO	RENDIMENTO	DIFERENÇA
	29/12/2010	5.000.000,00 (*)				
	30/09/2013			4.997.751,49		
	ATÉ 30/10/2013				1.534.183,50	
	Subtotal	5.000.000,00		4.997.751,49	1.534.183,50	
HISTÓRICO:	DATA	OCORRÊNCIAS				
	06/06/2013	ASSEMBLÉIA PRORROGA PRAZO DE RESGATE PARA MAIS 05 ANOS E ELEVA RENTABILIDADE PARA 140% DO CDI (SBCPREV VOTOU CONTRA)				
	14/10/2013	PLANNER APRESENTA FATO RELEVANTE REFERENTE AO AUMENTO DA INADIMPLÊNCIA E DESENQUADRAMENTO DE COTA SUBORDINADA E CONVOCA ASSEMBLÉIA GERAL EXTRAORDINÁRIA PARA 24/10/2013 PRAZO: PRORROGADO PARA 15 ANOS - SALDO DA CARTEIRA: R\$ 400.205.667,70 INADIMPLÊNCIA DE: R\$ 111.839.428,76 (28%) EM 30/09/2013				
	24/10/2013	AGE DELIBERA PELA TROCA DA “GESTORA” E PEDE NOVA AGE EM 21/11/2013 PARA ADMINISTRADORA APRESENTAR PROPOSTA DE NOVOS GESTORES E A REAL SITUAÇÃO DA INADIMPLÊNCIA COM POSSÍVEIS MEDIDAS A SEREM ADOTADAS				
CONCLUSÃO:	PARECER E NOTAS					
05/11/2013	SBCPREV PARTICIPOU DA AGE DE 24/10/2013 E PARTICIPARÁ DA PRÓXIMA AGE EM 21/11/2013					

QUADRO DE INVESTIMENTOS SBCPREV FFIN2 – 30/09/2013

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ REND A FIXA	VLR. APLICADO
		Nominal
Títulos Públicos		25.692.490,90
Santander (custodiante)	NTN-B (ipca)	3.603.961,59
Santander (custodiante)	NTN-C (igpm)	5.700.244,52
Santander (custodiante)	NTN-B (ipca)	16.388.284,79
Fundos que contenham somente títulos públicos		118.138.569,97
Santander	FIC RF IMA-B Títulos Públ.- 11.180.607/0001-17	45.657.767,89
Bco do Brasil	BB Previd IMA-B TPúbl. - 07.442.078/0001-05	54.854.627,07
ITAÚ	Instit RF Inflação IMA B - 10.474.513/0001-98	17.626.175,01
Fundos Renda Fixa/Referenciados Renda Fixa IMA IRF IDkA		106.199.597,12
Bco do Brasil	BB Previd RF IMA-B - 07.861.554/0001-22	41.332.995,07
Bradesco	Bradesco FI RF - IMA-B - 08.702.798/0001-25	24.599.364,25
CEF	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	40.267.237,80
Fundos de Renda Fixa (normal)		2.614.345,63
Santander	FIC Institucional Ref DI - 01.380.259/0001-78	-
Santander	FIC Instit Master DI - 02.367.527/0001-84	2.596.427,48
Santander	FIC Classic DI - 03.235.471/0001-77	10.192,33
Bco do Brasil	Previd RF Fluxo - 13.077.415/0001-05	7.725,82
FIDC Aberto		19.967.780,11
Cruzeiro do Sul ⁽³⁾	Verax CPP 360 Senior - 06.318.094/0001-28	8.569.980,22
BMG	BMG RPPS - 12.604.345/0001-33	7.413.605,54
Ourinvest	Suppliercard Senior 1 - 08.692.888/0001-82	3.984.194,35
FIDC Fechado		5.036.256,94
BVA	Multisetorial Master II - 11.989.256/0001-90	38.505,45
Trend Bank	Senior Multsetorial - 08.927.488/0001-09	4.997.751,49
Fundo de Crédito Privado		20.921.104,61
CEF	Caixa - IPCA VI (7,74 aa) - 12.321.787/0001-72	7.484.129,11
CEF	Caixa RF-IPCA XIII (7,5 aa)-13.058.824/0001-64	7.165.465,00
CEF	Caixa RF-IPCA XV (7,5 aa)-13.058.879/0001-74	6.271.510,50

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ RENTA VARIÁVEL	VLR. APLICADO
		Nominal
Fundo de Ações Referenciado		40.100.723,35
ITAÚ	Itaú RPI Ações Ibov FICFI - 08.817.414/0001-10	3.741.948,37
BNP Paribas	Ace Ações IBRX - 04.362.333/0001-11	7.490.179,95
CEF	FIA Caixa Brasil ETF CNPJ 15.154.236/0001-50	4.750.762,67
BTG Pactual	FIQ FIA Multigestores 14.806.170/0001-72	4.759.897,12
HSBC	FIC Ações Reg. Previdência - 11.232.995/0001-32	19.357.935,24
Fundo de Ações		39.137.839,63
VOTORANTIM	FIA Vot Ações -68.169.457/0001-68	-
VOTORANTIM Vision	FIA Vot Ações Small Cap -10.347.277/0001-49	892.392,52
QUEST	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	8.513.721,63
ITAÚ	FIA Ações Dividendos -02.887.290/0001-62	4.974.017,63
Safra	FIA Small Cap - 05.857.973/0001-65	-
CEF	FIC Valor Dividendos CNPJ 15.154.441/0001-15	5.018.111,65
BNY Mellon ⁽²⁾	ARX Income FI Ações-Divid - 03.168.062/0001-03	11.081.625,46
Sul América	Sul América Total Return - 11.458.144/0001-02	8.657.970,74
Fundo de Índices		
Fundo Multimercado		2.009.859,87
Geração Futuro	GF FIC FI Multimer. CNPJ - 15.796.3570001-03	2.009.859,87

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ ESTRUTURADOS	VLR. APLICADO
		Nominal
Fundo Imobiliário		8.498.644,42
RB Capital	FII Renda II - 09.006.914/0001-34	8.498.644,42
Fundo de Participações		1.792.031,66
Kinea	FIP CNPJ 16.437.148/0001-28	1.591.468,20
BRZ Brasil Portos	FIP CNPJ 14.737.553/0001-36	200.563,46
Disponibilidade de Caixa		1.089.152,00
Disponibilidade em Caixa FFIN1		1.089.005,32
Disponibilidade em Caixa FFIN2		146,68
TOTAL DE ATIVOS		391.198.396,21



WWW.SBCPREV.SAOBERNARDO.SP.GOV.BR

PORTAL DA TRANSPARÊNCIA