

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 31/01/2019

INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Resgate	Resgate	VLR. APLICADO		Rentabilidade			Limites		SEGMENTO / CATEG	Limites					NORMA
				Nominal	% Patr	Mês	Exercício	% Benchmark ano	PL do Fundo	%		Aplicado RPPS	RESOL 3.922	Politic Invest	%PL do Fundo	Máx PI do RPPS por Fundo	
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA																	
Títulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea A				59.452.931,21		17,77%											
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2019 - 4.000			12.951.160,31	3,87%	0,64%	IPCA + 6,599092 % aa				Títulos Públicos	17,77%	100%	40%	0%	0%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A"
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 2.000			6.941.697,18	2,07%	2,15%	IPCA + 6,35 % aa	4,2982%									
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400			12.310.198,43	3,68%	3,18%	IPCA + 6,248 % aa										
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000			15.138.819,61	4,53%	6,20%	IPCA + 5,688 % aa										
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200			12.111.055,68	3,62%	6,20%	IPCA + 7,484 % aa										
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B				185.308.908,18		55,39%											
Santander	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ.- 13.455.117/0001/01	D+0	D+1	40.853.549,87	12,21%	1,52%	do IMA-B	1.308.500.780	3,12%		Renda Fixa TP	55,39%	100%	50%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B"
Santander	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D+0	D+1	10.984.651,72	3,28%	1,37%	do IMA-B	1.632.718.767	0,67%								
Bco do Brasil FFINPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D+0	D+1	16.156.102,06	4,83%	1,37%	do IRF-M	5.222.909.560	0,31%								
Bco do Brasil FFINPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D+0	D+1	21.594.618,60	6,45%	1,52%	do IMA-B5	3.212.136.258	0,67%								
CEF FFINPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D+0	D+0	38.711.775,32	11,57%	1,35%	do IMA-B5	2.521.307.221	1,54%								
CEF FFINPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10	D+0	D+0	51.798.203,89	15,48%	1,53%	do IMA-B5	8.675.733.039	0,60%								
Western Asset FFINPREV	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-7	D+0	D+1	5.210.006,72	1,56%	2,18%	do IMA-B5	282.925.225	1,84%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea C											Renda Fixa TP	0%	100%	0%	15%	20%	Art. 7º, Inciso I, Alínea C
Operações Compromissadas Lastreadas 100%em TP do TN - Art. 7º, Inciso II											Renda Fixa TP	0%	5%	0%	15%	20%	Art. 7º, Inciso II
Fundos "Referenciados" em Indicadores RFixa (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso III, Alínea "A"				24.443.493,78		7,31%					Renda Fixa Referenciado						
CEF FFINPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D+0	D+0	24.443.493,78	7,31%	4,32%	do IMA-B	2.207.015.970	1,11%	Renda Fixa Referenciado	7,31%	60%	35%	15%	20%	Art. 7º, Inciso III, Alínea "A" (15% PL do FI)	
Fundos de Índice ETF Renda Fixa em Indicadores de Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso III, Alínea B											Renda Fixa	0%	60%	0%	15%	20%	Art. 7º, Inciso III, Alínea "B"
Fundos de Renda Fixa Geral - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "A"				30.370.419,23		9,08%											
Santander FFPREV-491-9	FIC Corporate RF Ref DI - 03.069.104/0001-40	D+0	D+0	0,00	0,00%	0,50%	do CDI	6.908.347.598	0,00%	Renda Fixa	9,08%	40%	30%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso IV "A"	
Bradesco FFINPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D+0	D+1	15.431.352,87	4,61%	1,58%	do IMA-B5	562.385.050	2,74%								
ITAÚ FFINPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D+0	D+1	9.194.331,08	2,75%	2,37%	IPCA	1.139.132.097	0,81%								
ICATU FFINPREV	Icatu Vang Infl Curta FI RF - 10.922.432/0001-03	D+0	D+1	5.744.735,28	1,72%	1,54%	do IMA-B5	317.528.755	1,81%								
Fundos de Índice ETF Renda Fixa - Quaisquer Indicadores - Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"											Renda Fixa	0%	40%	0%	15%	20%	Art. 7º, Inciso IV, Alínea "B"
Letras Imobiliárias Garantida - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"											Renda Fixa	0%	20%	0%	15%	20%	Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"
Certificados de Depósitos Bancários - CDB (limitado ao FGC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"											Renda Fixa	0%	15%	0%	15%	20%	Art. 7º, Inciso VI, Alínea "A"
Poupança (limitado ao FGC) - Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B"											Renda Fixa	0%	15%	0%	15%	20%	Art. 7º, Inciso VI, Alínea "B"
FIDC Cotas Sênior - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A"											Renda Fixa	0%	5%	2%	5%	20%	Art. 7º, Inciso VII, Alínea "A"
Fundos Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B"											Renda Fixa	0%	5%	1%	5%	20%	Art. 7º, Inciso VII, Alínea "B"
Fundos de Debêntures de Infraestrutura - Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C"											Renda Fixa	0%	5%	0%	5%	20%	Art. 7º, Inciso VII, Alínea "C"
INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS																	
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"				30.558.907,73		9,13%					89,54%						
ITAÚ FFINPREV	Instit Ações Phoenix FIA -23.731.629/0001-07	D+21	D+24	11.302.601,90	3,38%	8,29%	do IBOV	1.449.444.222	0,78%	Renda Variável	9,13%	30%	15%	15%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"	
AZQUEST FFINPREV	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	8.873.229,33	2,65%	6,46%	do SMLL	861.352.878	1,0%								
AZQUEST FFINPREV	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	4.699.437,96	1,40%	7,42%	do IBOV	845.160.634	0,6%								
XP Investimentos FFPREV	XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12	0,54	D+4	5.683.638,54	1,70%	13,04%	do IDIV	329.200.606	1,73%								
Fundos ETF Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "B"											Renda Variável	0%	30%	0%	15%	20%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea "B"
Fundo de Ações em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "A"				0,00		0,00%					Renda Variável	0%	20%	15%	15%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"
Fundo ETF Índices em Geral - Art. 8º, Inciso II, Alínea "B"											Renda Variável	0%	20%	0%	15%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B"
Fundos Multimercados - Aberto (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso III				3.515.654,78		1,05%											
Western Asset FFINPREV	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	3.515.654,78	1,05%	7,69%	do CDI	846.598.576	0,42%	Renda variável	1,05%	10%	3%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso III	
Fundo de Participações - FIP (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"				904.851,61		0,27%											
Kinea IV Feeder FFPREV	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	904.851,61	0,27%	-3,48%	IPCA	24.053.972	3,76%	FIP Participações	0,27%	5%	3%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A"	
Fundo Imobiliário FII - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"						0,00%					Imobiliário	0,00%	5%	3%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B"
Fundo de Ações - Mercado de Acesso (Investimentos Estruturados) - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C"											Renda Variável	0%	5%	0%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "C"
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR																	
Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso I											Exterior	0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso I
Investimento no Exterior (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso II											Exterior	0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso II
Fundo de Ações - BDR-Nível 1 (Investimentos no Exterior) - Art. 9º-A, Inciso III											Exterior	0%	10%	0%	15%	20%	Art. 9º-A, Inciso III
Disponibilidade de Caixa				0,00		0,00%											
Disponibilidade em Caixa FFPREV(Santander)						0,00%											
Disponibilidade em Caixa FFPREV(CEF + Santander + Itaú)						0,00%					Disponibilidade	0,00%					
TOTAL DE ATIVOS				334.555.166,52		100,00%						100,00%		100,00%			
Meta Atuarial(INPC (+)0,14 + 0,486755)	0,85%	IBOVESPA	10,82%	IFIX	2,47%	IRF-M	1,39%	FFPREV - Ano	2,29%								
Rentabilidade no mês SBCPREV FFPREV	2,89%	IBRX	10,71%	IMA-B	4,37%	IRFM 1	0,58%	Meta Atuarial - Ano	0,85%								
INPC	0,36%	IBRX50	10,44%	IMA-G	1,91%	IRFM 1+	1,71%	FFPREV - 12 meses	12,04%								
CDI	0,54%	SMLL	9,41%	IMA-B 5	1,54%	IMA-C	1,99%	Meta Atuarial - 12 Meses	9,70%								
IPCA	0,32%	IDIV	12,48%	IMA-B 5+	6,61%	IMA-S	0,54%		334.555.166,52								
									887.166.044,29								
									1.221.721.210,81								

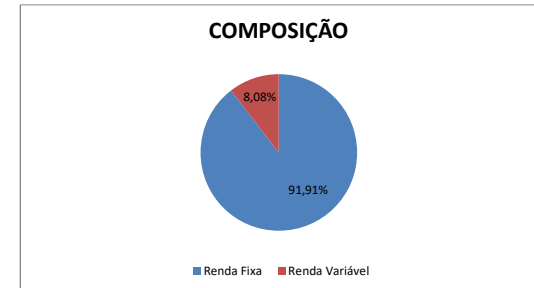
Total FFIN2 + FFINPrev

IBOVESPA

Renda Fixa	rentabilidade no mês	2,29%	299.575.752,40	89,54%	Renda Fixa	933.034.014,82	82,84%
Renda Variável	rentabilidade no mês	8,03%	34.979.414,12	10,46%	Renda Variável	193.252.694,18	17,16%
Disponibilidade Caixa		2,89%	334.555.166,52	100,00%	Disponibilidade de Caixa	7.943,81	0,00%
					Total Geral	1.126.294.652,81	100,00%

Lim Resol

FFPREV	Janeiro 2019	334.555.166,52	100,00%	100,00%
RENTA FIXA				
		299.575.752,40	89,54%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" (TP Federal)		59.452.931,21	17,77%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos TP)		185.308.908,18	55,39%	100,00%
Art. 7º, Inciso I, Alínea C (Índice ETF)		0,00	0,00%	100,00%
Art. 7º, Inciso II (Op.Compromissadas)		0,00	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III "A" (Fundos Referenciados)		24.443.493,78	7,31%	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)		30.370.419,23	9,08%	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)		0,00	0,00%	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%
RENTA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS				
		34.979.414,12	10,46%	50,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" (FIA abertos indicas)		30.558.907,73	9,13%	30,00%
Art. 8º, Inciso I, Alínea "B" (Fundos ETF indicas)		0,00	0,00%	30,00%
Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" (FIA aberto carteira livre)		0,00	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" (Fundos ETF carteira livre)		0,00	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III (Fundos Multimercado)		3.515.654,78	1,05%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" (FIP fechado)		904.851,61	0,27%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "B" (FI Imobiliário)		0,00	0,00%	5,00%
Art. 8º, Inciso IV, Alínea "C" - FAções - Mercado de Acesso		0,00	0,00%	5,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR				
		0,00	0,00%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso I - Fundo de Renda Fixa - Dívida Externa		0,00	0,00%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso II - Investimento no Exterior		0,00	0,00%	10,00%
Art. 9º-A, Inciso III - Fundo de Ações - BDR-Nível 1		0,00	0,00%	10,00%
Disponibilidade de Caixa				
		0,00	0,00%	0,00%



CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Títulos Públicos	59.452.931,21	17,77%
CEFederal	114.953.472,99	34,36%
Santander	51.838.201,59	15,49%
Banco do Brasil	37.750.720,66	11,28%
Itaú	20.496.932,98	6,13%
Bradesco	15.431.352,87	4,61%
AZQuest	13.572.667,29	4,06%
Western	8.725.661,50	2,61%
ARX Investimentos	0,00	0,00%
Safra	0,00	0,00%
Kinea/Itaú	904.851,61	0,27%
Icatu Vanguard	5.744.735,28	1,72%
RBCapital	0,00	0,00%
Vinci Partner's/CEF	0,00	0,00%
Ourinvest	0,00	0,00%
Mongeral Aegon	0,00	0,00%
Reag	0,00	0,00%
XP Investimentos	5.683.638,54	1,70%
BTG	0,00	0,00%
BRZ	0,00	0,00%
TrendBank	0,00	0,00%
BVA	0,00	0,00%
Saldo Caixa	0,00	0,00%
TOTAL	334.555.166,52	

	% do total	RENTA FIXA	% da Rfixa
Títulos Públicos	17,77%	59.452.931,21	19,85%
IMA-B	7,31%	24.443.493,78	8,16%
IMA-B5	40,48%	135.422.460,51	45,20%
IMA-B5 - ATIVO	1,56%	5.210.006,72	1,74%
Alocação Dinâmica	2,75%	9.194.331,08	3,07%
IRF-M	19,68%	65.852.529,10	21,98%
DI + Outros R Fixa	0,00%	0,00	0,00%
FIDC	0,00%	0,00	0,00%
	89,54%	299.575.752,40	100,00%