

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE QUANTITATIVAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 3.922 - BASE: 30/06/2019																	
INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Resgate	Resgate	VLR. APLICADO		Rentabilidade			Limites		SEGMENTO / CATEGORIA	Limites					NORMA
				Nominal	% Patr	Mês	Exercício	% Benchmark ano	PL do Fundo	%		Aplicado RPPS	RESOL 3.922	Politic Invest	%PL do Fundo	Max Pl do RPPS por Fundo	
<b>INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA</b>																	
Títulos Públicos de Emissão do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea A				50.519.183,64	13,01%												
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2023 - 2.000			7.234.451,70	1,86%	-0,70%		IPCA + 6,35 % aa	4,6592%								
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400			13.115.777,80	3,38%	3,09%		IPCA + 6,248 % aa		Renda Fixa TP	13,01%	100%	40%	0%	0%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A"	
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000			16.760.530,08	4,32%	2,84%		IPCA + 5,688 % aa									
CEFederal (custodiante) FFINPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200			13.408.424,06	3,45%	2,84%		IPCA + 7,484 % aa									
Fundos Referenciados Renda Fixa que contêm 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B				225.291.853,40	58,02%												
Santander	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ.- 13.455.117/0001/01	D+0	D+1	49.173.219,50	12,66%	1,70%		do IMA-B	1.431.616.242	3,43%	Renda Fixa TP	58,02%	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	11.581.629,78	2,98%	2,15%		do IMA-B	1.738.803.823	0,67%							
Santander FFPREV-491-9	FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D+0	D+1	22.797.021,73	5,87%	3,71%		do IMA-B	879.027.129	2,59%							
Bco do Brasil FFINPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D+0	D+1	17.031.896,47	4,39%	2,14%		do IRF-M	5.039.967.565	0,34%							
Bco do Brasil FFINPREV	BB Previd RF IMA-B5 - 03.543.447/0001-03	D+0	D+1	12.249.522,19	3,15%	1,70%		do IMA-B5	3.911.936.273	0,31%							
CEF FFINPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D+0	D+0	40.785.630,07	10,50%	2,15%		do IMA-B5	2.566.614.967	1,59%							
CEF FFINPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10	D+0	D+0	52.437.924,52	13,50%	1,70%		do IMA-B5	9.698.474.109	0,54%							
Sul América - FFINPREV	INFLATIE FI RF LP 09.326.708/0001-01	D+1	D+2	13.656.665,44	3,52%	3,24%		do IMA-B	1.476.528.536	0,92%							
Western Asset FFINPREV	WA IMA-B5 Ativo FI Renda Fixa CNPJ 17.517.577/0001-78	D+0	D+1	5.578.343,70	1,44%	2,45%		do IMA-B5	370.113.337	1,51%							
Fundos de Índice ETF Renda Fixa que contêm 100% TP do TN - 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 Rfica (podem ter crédito privado) Art. 7º, Inciso III, Alínea "A"				27.284.088,14	7,03%												
CEF FFINPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D+0	D+0	27.284.088,14	7,03%	3,68%	3,58%	do IMA-B	817	#VALOR!	Renda Fixa Referenciado	7,03%	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"				32.125.863,50	8,27%												
Santander FFPREV-491-9	FIC Instit RF REF DI - 02.224.354/0001-46	D+0	D+0	43.007,97	0,01%	0,46%		do CDI	5.314.370.074	0,00%	Renda Fixa	8,27%	40%	25%	15%	20%	Artigo 7º, Inciso IV "A"
Bradesco FFINPREV	Bradesco FIC FI RF - IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D+0	D+1	16.283.893,52	4,19%	1,73%		do IMA-B5	697.895.785	2,33%							
ITAÚ FFINPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D+0	D+1	9.732.093,23	2,51%	2,55%		IPCA	4.446.123.061	0,22%							
ICATU FFINPREV	icatu Vang Inf Curta FI RF 10.922.432/0001-03	D+0	D+1	6.066.868,78	1,56%	1,73%		do IMA-B5	431.167.693	1,41%							
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%	0%	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"
<b>INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS</b>																	
Fundo de Ações Índices com no mínimo 50 ações - Art. 8º, Inciso I, Alínea "A"					0,00%												
Fundos ETF 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"				45.118.710,58	11,62%						86,33%						
ITAÚ FFINPREV	Instit Ações Phoenix FIA - 23.731.629/0001-07	D+21	D+24	18.121.626,14	4,67%	4,88%		do IBOV	1.622.441.071	1,12%	Renda Variável	11,62%	20%	10%	15%	20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "A"
AZQUEST FFINPREV	FIC FIA Small Cap - 11.392.165/0001-72	D+27	D+28	9.277.132,92	2,39%	5,50%		do SMLL	896.607.072	1,0%							
AZQUEST FFINPREV	FIC FIA Ações - 07.279.657/0001-89	D+1	D+4	4.811.136,33	1,24%	3,39%		do IBOV	860.840.540	0,6%							
XP Investimentos FFPREV	XP Dividendos FIA - 16.575.255/0001-12	D+1	D+4	6.231.516,68	1,60%	4,61%		do IDIV	329.404.985	1,89%							
ICATU FFINPREV	icatu Vang Dividendos FIA 08.279.304/0001-41	D+1	D+5	6.677.298,51	1,72%	5,06%	1,98%	do IDIV	864.248.342	0,77%							
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				3.882.314,64	1,00%												
Western Asset FFINPREV	WA US Index 500 CNPJ 17.453.850/0001-48	D+0	D+1	3.882.314,64	1,00%	7,12%		do CDI	763.457.082	0,51%	Renda variável	1,00%	10%	10%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso III
Fundo de Participações - FIP - (Investimentos Estruturados) Art. 8º, Inciso IV, Alínea "A"				4.074.427,31	1,05%												
Vinci Cap Partners FFPREV	FIP Multiesratégia II CNPJ 30.507.217/0001-53	Fechado	Fechado	0,00	0,00%	0,00%		IPCA	0	#DIV/0!	FIP Participações	1,05%	5%	5%	5%	20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A"
Kinea IV Feeder FFPREV	FIP CNPJ 27.782.774/0001-78	Fechado	Fechado	4.074.427,31	1,05%	-0,50%		IPCA	108.311.859	3,76%							
Fundo Imobiliário FII - Art. 8º, Inciso IV, Alínea "B"					0,00%												
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"
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>																	
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%										
<b>TOTAL DE ATIVOS</b>				388.296.441,21	100,00%												
Meta Atuarial(INPC (+)0,14 + 0,486755)		0,50%	IBOVESPA	4,06%	IFIX	2,88%	IRF-M	2,16%	FFPREV - Ano						10,48%		
Rentabilidade no mês SBCPREV FFPREV		2,90%	IBRX	4,10%	IMA-B	3,73%	IRFM 1	0,58%	Meta Atuarial - Ano						5,48%		
INPC		0,01%	IBRX50	4,12%	IMA-G	2,00%	IRFM 1+	2,72%	FFPREV - 12 meses						20,26%		
CDI		0,47%	SMLL	6,99%	IMA-B 5	1,72%	IMA-C	3,84%	Meta Atuarial - 12 Meses						9,50%		
IPCA		0,01%	IDIV	3,11%	IMA-B 5+	5,06%	IMA-S	0,47%						388.296.441,21			
Total FF22 + FFINPREV				1.349.607.110,00											961.310.668,79		
															1.349.607.110,00		

Renda Fixa  
Renda Variável  
Disponibilidade de Caixa

rentabilidade no mês **2,65%**  
rentabilidade no mês **4,57%** 3,71  
**2,90%** 3,19

335.220.988,68 86,33%  
53.075.452,53 13,67%  
0,00 0,00%  
388.296.441,21 100,00%

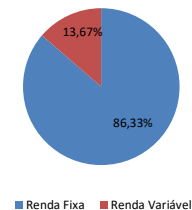
Renda Fixa 933.034.014,82 82,84%  
Renda Variável 193.252.694,18 17,16%  
Disponibilidade de Caixa 7.943,81 0,00%  
Total Geral 1.126.294.652,81 100,00%

Consolidado

FFPREV	Abril 2019	388.296.441,21	100,00%	100,00%
<b>RENDA FIXA</b>		<b>335.220.988,68</b>	<b>86,33%</b>	<b>100,00%</b>
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A" ( TP Federal )		50.519.183,64	13,01%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "B" ( Fundos TP)		225.291.853,40	58,02%	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)		27.284.088,14	7,03%	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 )		32.125.863,50	8,27%	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%
<b>RENDA VARIÁVEL E ESTRUTURADOS</b>		<b>53.075.452,53</b>	<b>13,67%</b>	<b>50,00%</b>
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "A" ( FIA abertos índices )		0,00	0,00%	30,00%
Art. 8º, Inciso I, Alínea "B" ( Fundos ETF índices )		0,00	0,00%	30,00%
Art. 8º, Inciso II, Alínea "A" ( FIA aberto carteira livre )		45.118.710,58	11,62%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "B" ( Fundos ETF carteira livre )		0,00	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III ( Fundos Multimercado )		3.882.314,64	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "A" ( FIP fechado )		4.074.427,31	1,05%	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%
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>
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%
<b>Disponibilidade de Caixa</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>

Lim Resol

## COMPOSIÇÃO



### CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Títulos Públicos	50.519.183,64	13,01%
CEFederal	120.507.642,73	31,03%
Santander	83.594.878,98	21,53%
Banco do Brasil	29.281.418,66	7,54%
Itaú	27.853.719,37	7,17%
Bradesco	16.283.893,52	4,19%
AZQuest	14.088.269,25	3,63%
Western	9.460.658,34	2,44%
Sul América	13.656.665,44	
ARX Investimentos	0,00	0,00%
Safra	0,00	0,00%
Kinea/Itau	4.074.427,31	1,05%
Icatu Vanguard	12.744.167,29	3,28%
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	6.231.516,68	1,60%
BTG	0,00	0,00%
BRZ	0,00	0,00%
TrendBank	0,00	0,00%
BVA	0,00	0,00%
Vinci Partner's/CEF	0,00	
Saldo Caixa	0,00	0,00%
<b>TOTAL</b>	<b>388.296.441,21</b>	

	% do total	RENDA FIXA	% da Rfixa
Títulos Públicos	13,01%	50.519.183,64	15,07%
IMA-B	16,41%	63.737.775,31	19,01%
IMA-B5	35,08%	136.211.428,51	40,63%
IMA-B5 - ATIVO	1,44%	5.578.343,70	1,66%
Alocação Dinâmica	2,51%	9.732.093,23	2,90%
IRF-M	17,87%	69.399.156,32	20,70%
DI + Outros R Fixa	0,01%	43.007,97	0,01%
FIDC	0,00%	0,00	0,00%

86,33%

335.220.988,68

100,00%