

SBCPREV - FFPREV - RELATÓRIO DE ENQUADRAMENTO PERANTE A RESOLUÇÃO 4.963/2021 - BASE: 31/05/2024

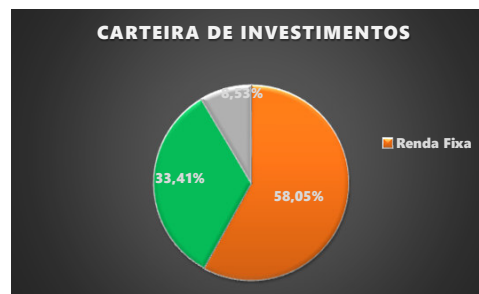
INSTITUIÇÕES	FUNDOS / CNPJ	Conversão	Resgate	VLR. APLICADO		Rentabilidade		Limites		SEGMENTO / CATEGORIA	Limites					NORMA								
				Nominal	% Patr do RPPS	Mês	% Benchmark ano	Pl do Fundo	% Pl do Fundo		Aplicado RPPS	RESOL 4.963 + Nível 1 Pró Gestão	Politic Invest	% Pl do Fundo	Máx PL do RPPS por Fundo		Enquadr. Resol. 4963/2021							
INVESTIMENTOS EM RENDA FIXA ART. 7º											58,05%	100,00%												
Carteira Própria - Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso I, Alínea A																								
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2026 - 3.400			521.715.988,35	28,37%	14.740.553,07	0,80%	1,52%	IPCA + 6,248% aa	do IPCA	Renda Fixa TP	28,37%	100%	100%	100%	100%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "A"							
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2027 - 12.000			51.244.946,44	2,79%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 6,306% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.450			14.634.184,42	0,80%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 6,23% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 6.000			25.450.755,52	1,38%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 6,49% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 8.500			36.055.236,98	1,96%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 7,484% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 3.200			13.573.736,28	0,74%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 7,484% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV Migr	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 13.000			55.143.303,62	3,00%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,688% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2035 - 4.000			16.967.170,34	0,92%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,688% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 6.000			25.835.451,43	1,40%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 4,941% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 5.075			21.852.486,00	1,19%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,235% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 4.925			21.206.599,72	1,15%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,235% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2040 - 6.200			26.696.633,15	1,45%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,650% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 6.000			25.344.638,71	1,38%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 4,961% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 6.300			26.611.870,64	1,45%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,700% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 10.000			42.241.064,51	2,30%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,255% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/05/2045 - 12.000			50.689.277,41	2,76%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,703% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2050 - 10.000			42.742.464,10	2,32%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 5,820% aa	do IPCA														
XP Investimentos (custodiante) FFPREV	NTN-B (ipca) venc 15/08/2050 - 2.500			10.685.616,03	0,58%	1.524.946,44	0,80%	1,52%	IPCA + 6,1600% aa	do IPCA														
FI Renda Fixa que contenham 100% TP do TN - Art. 7º, Inciso I, Alínea B				400.088.876,45	21,76%														21,76%					
Bco do Brasil FFPREV	BB PREV. RF ALOC ATIVA RETORNO TOTAL - 35.292.588/0001-1	D+3	D+3	75.809.676,29	4,12%	0,72%				do IPCA								Renda Fixa TP	21,76%	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	13.476.879,71	0,73%	1,03%				do IMA-B5														
Bco do Brasil FFPREV	BB Previd RF IRF-M - 07.111.384/0001-69	D+0	D+1	18.005.021,21	0,98%	0,64%				do IRF-M														
CEF FFPREV	CAIXA FIC BRASIL GEST ESTR RF - 23.215.097/0001-55	D+0	D+0	36.064.138,29	1,96%	0,70%				do IMA-B5														
CEF FFPREV	CX FI Brasil IMA-B5 TPRF - 11.060.913/0001-10	D+0	D+0	44.076.951,19	2,40%	1,03%				do IMA-B5														
CEF FFPREV	FI IRF-M RF LP - 14.508.605/0001-00	D+0	D+0	15.386.635,98	0,84%	0,63%				do IRF-M														
ICATU FFPREV	icatu Vang Infl Curta FI RF - 10.922.432/0001-03	D+0	D+1	36.025.175,45	1,96%	1,02%				do IMA-B5														
Mongeral Aegon FFPREV	MAG Inflação ALOCACAO DINAMICA - 14.115.118/0001-70	D+2	D+3	7.058.074,11	0,38%	1,22%				do IMA-B														
Santander FFPREV	FIC FI IMA-B5 Títulos Públ. - 13.455.117/0001-01	D+0	D+1	81.381.617,68	4,43%	1,03%				do IMA-B5														
Santander FFPREV	FI IMA-B Títulos Públ. RF - 14.504.578/0001-90	D+0	D+1	45.614.218,18	2,48%	1,30%				do IMA-B														
Santander FFPREV	FI IRF-M Títulos Públ. RF - 13.455.197/0001-03	D+0	D+1	15.128.365,49	0,82%	0,64%				do IRF-M														
ITAÚ FFPREV	Instit ALOC DIN RF FIC - 21.838.150/0001-49	D+0	D+1	12.062.122,87	0,66%	0,75%				do IPCA														
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%	5%	-	-	Art. 7º, Inciso II							
Fundos de Renda Fixa conforme CVM Art. 7º, Inciso III, Alínea A				145.043.428,17	7,89%							7,89%												
Santander FFPREV 491-9	DI Institucional Premium - 02.224.354/0001-45	D+0	D+0	21.556.874,00	1,17%	0,56%				do CDI	Renda Fixa	7,89%	65%	60%	15%	20%	Art. 7º, Inciso III, Alínea "A" (15% PL do FI)							
Bco do Brasil FFPREV Migr	BB Previd RF IMA-B - 07.861.554/0001-22	D+0	D+1	16.892.510,36	0,92%	1,29%				do IMA-B														
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF IMA-B5 - 20.216.216/0001-04	D+0	D+1	39.683.458,27	2,16%	1,03%				do IMA-B5														
Bradesco FFPREV	Bradesco FIC FI RF IMA-B - 08.702.798/0001-25	D+0	D+1	23.777.383,43	1,29%	1,27%				do IMA-B														
CEF FFPREV	Novo Brasil IMA-B RF - 10.646.895/0001-90	D+0	D+0	18.457.585,54	1,00%	1,30%				do IMA-B														
RIO BRAVO Venc. 21/09/2025 Cap. Prot retorno mínimo de	Rio Bravo Estratégico Ima-B FI RF - 49.232.373/0001-87	D+1	D+760	16.149.688,50	0,88%	0,74%				do IMA-B														
RIO BRAVO Venc. 16/06/2025 Cap. Prot retorno mínimo de	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF - 50.533.505/0001-90	D+1	D+760	8.525.928,07	0,46%	1,03%				do IMA-B														
Fundos de Índice ETF - Conforme CVM - Art. 7º, Inciso III, Alínea B				0,00	0,00%						Renda Fixa	0,00%	65%	60%	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. - Art. 7º, Inciso IV				0,00	0,00%						Renda Fixa	0,00%	20%	20%	-	-	Artigo 7º, Inciso IV							
Fundos de Investimento em Direitos Creditórios - FIDC Cota Sênior - Art. 7º, Inciso V, Alínea A				593.854,27	0,03%							0,03%												
BVA FFPREV Migr	Multisetorial Master II - 11.989.256/0001-90	Fechado	Fechado	593.854,26	0,03%	2,50%				do CDI	Renda Fixa	0,03%	5%	5%	5% PL Cota Sênior	20%	Art. 7º, Inciso V, Alínea "A"							
Trend Bank FFPREV Migr	Senior Multisetorial - 08.927.488/0001-09	Fechado	Fechado	0,01	0,00%	0,00%				do CDI														
Fundos de Renda Fixa com sufixo "Crédito Privado" - Art. 7º, Inciso V, Alínea "B"				0,00	0,00%						Renda Fixa	0,00%	5%	5%	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%	5%	5%	20%	Art. 7º, Inciso V, Alínea C							

Meta Atuarial (INPC+ 4,91%aa)= (+) 0,46%+ 0,400238)	0,86%
Rentabilidade no mês SBCPREV FFPREV	0,53%
INPC	0,46%
CDI	0,83%
IPCA	0,46%

FFPREV - Ano	0,15%
Meta Atuarial - Ano	4,46%
FFPREV - 12 meses	10,11%
Meta Atuarial - 12 Meses	8,27%
	1.838.874.498,89

CARTEIRA DE INVESTIMENTO - FFPREV				
Renda Fixa	Rentabilidade no mês	1,25%	1.067.442.147,24	58,05%
Renda Variável + Estruturados + FI	Rentabilidade no mês	-1,62%	614.343.506,25	33,41%
Exterior	Rentabilidade no mês	3,71%	156.893.847,43	8,53%
Consignados			0,00	0,00%
Total dos Investimentos			1.838.679.500,92	
Disponibilidade Caixa			194.997,97	0,01%
Total Geral		0,53%	1.838.874.498,89	100,00%

CARTEIRA DE INVESTIMENTO - CONSOLIDADO			
FFIN1			421.122,16
Santander DI Inst. Premium - 02.224.354/0001-45	Rentabilidade no mês	0,22%	181.849,48
Disponibilidade Caixa			239.272,68
TXADM			16.208.686,52
Santander DI Inst. Premium - 02.224.354/0001-45	Rentabilidade no mês	0,83%	15.956.688,16
Disponibilidade Caixa			251.998,36
FFPREV			1.838.874.498,89
TOTAL CONSOLIDADO (FFIN1 + TXADM + FFPREV)			1.855.504.307,57



FFPREV	Maio 2024	1.838.874.498,89	100,00%	100,00%
RENDA FIXA ART. 7º		1.067.442.147,24	58,05%	100,00%
Carteira Própria - Títulos Públicos - Art. 7º, Inciso I, Alínea A		521.715.988,35	28,37%	100,00%
FI Renda Fixa que contenham 100% TP do TN- Art. 7º, Inciso I, Alínea B		400.088.876,45	21,76%	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 Comprorissadas com Lastro em TPF - Art. 7º, Inciso II		0,00	0,00%	5,00%
Fundos de Renda Fixa conforme CVM Art. 7º, Inciso III, Alínea A		145.043.428,17	7,89%	65,00%
Fundos de Índice ETF - Conforme CVM - Art. 7º, Inciso III, Alínea B		0,00	0,00%	65,00%
Ativos Financeiros de RF de emissão com obrigação 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 Creditórios - FIDC Cota Sênior - Art. 7º, Inciso V, Alínea A		593.854,27	0,03%	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		377.199.804,11	20,51%	30,00%
Fundo de Ações em Geral - CVM - Art. 8º, Inciso I		356.365.589,24	19,38%	35,00%
Fundo de Índice - ETF Renda variável - CVM - Art. 8º, Inciso II		0,00	0,00%	35,00%
Fundo de Investimento em BDR-Ações - Art. 8º, Inciso III (Pendente de Regulamentação)		20.834.214,87	1,13%	10,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR ART. 9º		156.893.847,43	8,53%	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		156.893.847,43	8,53%	10,00%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS ART. 10º		225.800.173,23	12,28%	15,00%
Fundo de Investimentos em Multimercado Art. 10º, Inciso I		151.140.039,05	8,22%	10,00%
Fundo de Investimentos em Participação Art. 10º, Inciso II		74.660.134,18	4,06%	5,00%
Fundo de Ações - Mercado de Acesso Art. 10º, Inciso III		0,00	0,00%	5,00%
FUNDOS IMOBILIÁRIOS ART. 11º		11.343.528,91	0,62%	5,00%
Fundo de Investimentos Imobiliário Art. 11º		11.343.528,91	0,62%	5,00%
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS ART. 12º		0,00	0,00%	5,00%
Empréstimos Consignados Art. 12º		0,00	0,00%	10,00%
Disponibilidade de Caixa		194.997,97	0,01%	0,00%

CONCENTRAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA		
Titulos Públicos	521.715.988,35	28,37%
Santander	213.904.693,28	11,63%
Banco do Brasil	177.085.876,04	9,63%
CEFederal	165.777.176,31	9,02%
BTG Pactual	103.276.058,29	5,62%
Rio Bravo	96.980.051,07	5,27%
XP Investimentos	73.166.145,77	3,98%
Itaú	68.220.491,91	3,71%
AZQuest	63.696.193,12	3,46%
Bradesco	63.460.841,70	3,45%
Vinci Partners/CEF	52.304.262,38	2,84%
ARX Investimentos	37.024.224,81	2,01%
Icatu Vanguard	36.025.175,45	1,96%
Tarpon	27.605.526,55	1,50%
Kinea/Itaú	25.868.217,67	1,41%
Mongeral Aegon	20.893.844,04	1,14%
Western	20.834.214,87	1,13%
Vinci Partner's	18.802.021,81	1,02%
Occam	14.002.683,65	0,76%
SPX	9.442.271,13	0,51%
BNP Paribas	9.463.196,57	0,51%
Reag	7.105.000,00	0,39%
SCHRÖDER	6.638.699,88	0,36%
RBCapital	4.238.528,91	0,23%
BRZ	554.263,09	0,03%
BVA	593.854,26	0,03%
TrendBank	0,01	0,00%
Saldo Caixa	194.997,97	0,01%
TOTAL	1.838.874.498,89	100,00%

RENDA FIXA			
	% do total		% da Rfixa
Titulos Públicos	28,37%	521.715.988,35	48,88%
IMA-B	6,57%	120.891.386,01	11,33%
IMA-B5	11,67%	214.644.082,30	20,11%
IPCA	0,46%	8.525.928,07	0,80%
Alocação Dinâmica	7,12%	130.994.011,56	12,27%
IRF-M	2,64%	48.520.022,68	4,55%
DI + Outros R Fixa	1,17%	21.556.874,00	2,02%
FIDC	0,03%	593.854,27	0,06%
Total	58,05%	1.067.442.147,24	100,00%
RENDA VARIÁVEL			
	% do total		% da Rfixa
Ações em Geral 8-I	19,38%	356.365.589,24	94,48%
ETF Ações 8-II	0,00%	0,00	0,00%
Ações BDR-Nível 1 -	1,13%	20.834.214,87	13,28%
Total	20,51%	377.199.804,11	94,48%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			
	% do total		% dos IE
Renda Fixa - Dívida E	0,00%	0,00	0,00%
FIC 9-II	8,53%	156.893.847,43	100,00%
Total	8,53%	156.893.847,43	100,00%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
	% do total	% dos Inv. Estruturados	
Multimercado 10-I	8,22%	151.140.039,05	66,94%
FIP 10-II	4,06%	74.660.134,18	33,06%
Ações - Mercado de	0,00%	0,00	0,00%
Total	12,28%	225.800.173,23	100,00%
FUNDOS IMOBILIÁRIOS			
	% do total		% Dos FItS
FImobiliário 11	0,62%	11.343.528,91	100,00%
Total	0,62%	11.343.528,91	100,00%
EMPRESTIMOS CONSIGNADOS			
	% do total		% dos Consignados
Emp. Consignados 1	0,00%	0,00	0,00%
Total	0,00%	0,00	0,00%
Disponibilidade Fina	0,01%	194.997,97	
TOTAL	100,00%	1.838.874.498,89	