riskoffice

Instituição	SBCPREV	Data	30/07/2014

Fundo	Valor Investido R$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	Adequação Fundo	Diversificação RPPS	Diversificação Fundo	Rentabilidades 1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano
CONSOLIDADO	**458.460.109,26**	**100,00%**	**145,00%**						**1,02%**	**4,71%**	**11,47%**	**8,39%**	**9,45%**
META ATUARIAL (INPC + 6%)									**0,62%**	**2,47%**	**6,32%**	**12,71%**	**7,52%**
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									**0,50%**	**2,35%**	**6,24%**	**12,89%**	**7,34%**
Títulos Públicos	**26.424.818,30**	**5,76%**	**7,00%**			**Art. 7o, Inciso I, Alínea A**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	26.424.818,30	5,76%							0,69%	2,34%	7,32%	10,34%	6,73%
Fundos que contenham somente títulos públicos	**128.418.949,25**	**28,01%**	**35,00%**			**Art. 7o, Inciso I, Alínea B**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TP	48.380.216,90	10,55%		6.307.435.272,52	0,77%	OK	OK	OK	1,11%	5,41%	13,43%	6,36%	10,49%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	8.322.535,36	1,82%		2.292.832.915,50	0,36%	OK	OK	OK	0,85%	3,42%	8,65%	10,35%	7,78%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	3.014.016,76	0,66%		1.642.135.649,71	0,18%	OK	OK	OK	0,82%	3,36%	8,58%	10,17%	7,70%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	19.174.747,84	4,18%		592.410.369,04	3,24%	OK	OK	OK	1,09%	5,38%	13,40%	6,26%	10,48%
SANTANDER FICFI IMA B TIT PUB RENDA FIXA	49.527.432,39	10,80%		531.050.868,90	9,33%	OK	OK	OK	1,04%	5,30%	13,56%	5,82%	10,39%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	**138.939.717,31**	**30,31%**	**35,00%**			**Art. 7o, Inciso III**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	45.384.721,04	9,90%		1.415.970.002,11	3,21%	OK	OK	OK	1,14%	5,49%	13,54%	6,45%	10,69%
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	6.172.896,25	1,35%		85.618.636,25	7,21%	OK	OK	OK	0,83%	3,34%	8,96%	-	6,01%
BRADESCO FI RF IMA B	26.805.538,61	5,85%		1.047.809.242,16	2,56%	OK	OK	OK	1,15%	5,47%	13,26%	6,44%	10,42%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	60.576.561,41	13,21%		2.603.725.461,59	2,33%	OK	OK	OK	1,07%	5,56%	13,10%	6,48%	10,61%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	**17.435.499,59**	**3,80%**	**8,00%**			**Art. 7o, Inciso IV**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	9.123.290,59	1,99%		5.015.760.413,52	0,18%	OK	OK	OK	0,96%	2,69%	5,17%	10,10%	6,07%
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	6.791.116,21	1,48%		188.725.326,81	3,60%	OK	OK	OK	0,71%	2,95%	6,58%	9,60%	7,40%
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	1.521.092,79	0,33%		4.077.122.409,81	0,04%	OK	OK	OK	0,88%	2,46%	4,72%	9,18%	5,56%
FIDC	**9.259.898,94**	**2,02%**	**4,00%**			**Art. 7o, Inciso VI**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BCSUL VERAX CPP 360 FIDC SENIOR	4.888.371,42	1,07%		51.354.859,67	9,52%	OK	OK	OK	1,05%	2,96%	5,70%	11,17%	6,69%
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	4.371.527,52	0,95%		235.232.366,02	1,86%	OK	OK	OK	1,08%	3,04%	5,86%	11,49%	6,88%
FIDC Fechado	**125.071,00**	**0,03%**	**4,00%**			**Art. 7o, Inciso VII, Alínea A**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
FIDC MULTISETORIAL BVA MASTER II SENIOR	86.017,84	0,02%		2.007.086,43	4,29%	OK	OK	OK	-2,55%	-55,20%	71,03%	903,46%	2120,72%
FIDC TRENDBANK SENIOR MULTISETORIAL	39.053,16	0,01%		944.412,82	4,14%	OK	OK	OK	-70,22%	-89,28%	-98,57%	-99,17%	-99,01%
Fundo Crédito Privado	**21.955.161,14**	**4,79%**	**5,00%**			**Art. 7o, Inciso VII, Alínea B**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	7.977.293,14	1,74%		80.608.912,22	9,90%	OK	OK	OK	0,72%	2,57%	5,71%	5,90%	6,79%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	7.453.795,00	1,63%		82.400.947,54	9,05%	OK	OK	OK	0,85%	2,86%	5,13%	4,94%	6,52%
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	6.524.073,00	1,42%		75.759.842,17	8,61%	OK	OK	OK	0,82%	2,82%	5,15%	4,57%	6,47%
Fundos de Ações Referenciados	**48.205.603,60**	**10,51%**	**15,00%**			**Art. 8o, Inciso I**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.980.287,17	1,74%		60.476.010,98	13,20%	OK	OK	OK	4,36%	5,17%	14,94%	12,82%	6,43%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.994.155,61	1,09%		38.694.548,72	12,91%	OK	OK	OK	1,57%	5,65%	11,96%	10,10%	4,07%
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.046.309,88	1,10%		36.208.107,76	13,94%	OK	OK	OK	5,14%	7,89%	16,97%	14,93%	7,69%
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.361.561,79	1,17%		461.716.270,85	1,16%	OK	OK	OK	-1,05%	12,41%	24,06%	32,47%	15,53%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	20.820.074,51	4,54%		309.910.489,32	6,72%	OK	OK	OK	2,68%	6,58%	15,08%	14,63%	6,40%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	4.003.214,64	0,87%		519.790.904,09	0,77%	OK	OK	OK	2,39%	5,43%	13,23%	13,79%	5,05%
Fundos de Índices de Ações			**2,00%**			**Art. 8o, Inciso II**					**Alocação:**		
Fundos de Ações	**44.649.780,19**	**9,74%**	**15,00%**			**Art. 8o, Inciso III**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	11.487.043,11	2,51%		274.788.237,75	4,18%	OK	OK	OK	4,75%	9,08%	14,31%	9,34%	6,36%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	2.447.034,69	0,53%		862.755.217,99	0,28%	OK	OK	OK	-0,74%	3,75%	13,12%	9,46%	6,67%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.222.833,79	1,14%		316.996.104,01	1,65%	OK	OK	OK	-0,90%	3,67%	12,81%	6,43%	5,25%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.285.490,15	1,15%		256.275.483,91	2,06%	OK	OK	OK	5,83%	9,06%	16,90%	13,06%	7,71%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	11.177.719,98	2,44%		260.171.739,84	4,30%	OK	OK	OK	-2,61%	3,88%	11,07%	3,65%	0,90%
SUL AMERICA TOTAL RETURN FIA	8.295.291,47	1,81%		135.279.774,75	6,13%	OK	OK	OK	-3,98%	5,23%	10,25%	-3,37%	-2,41%
VOTORANTIM FI VISION EM ACOES	734.367,00	0,16%		43.768.019,39	1,68%	Desenquadrado	OK	OK	-3,30%	6,80%	0,63%	-20,51%	-10,28%
Fundos Multimercados	**2.203.879,52**	**0,48%**	**5,00%**			**Art. 8o, Inciso IV**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.203.879,52	0,48%		146.793.610,52	1,50%	OK	OK	OK	0,04%	2,90%	5,97%	9,19%	6,66%
Fundos de Participações	**5.479.896,48**	**1,20%**	**5,00%**			**Art. 8o, Inciso V**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	206.366,99	0,05%		93.400.330,18	0,22%	OK	OK	OK	-1,02%	-2,73%	-4,37%	-3,27%	-5,15%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	787.277,25	0,17%		198.830.985,60	0,40%	OK	OK	OK	-0,69%	-1,11%	-2,57%	6,25%	0,71%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.486.252,24	0,98%		31.852.390,84	14,08%	OK	OK	OK	-0,28%	3,46%	2,17%	2,23%	6,18%
Fundos de Investimento Imobiliários	**15.193.140,29**	**3,31%**	**5,00%**			**Art. 8o, Inciso VI**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
DOMO FII	7.300.000,00	1,59%		171.479.554,83	4,26%	OK	OK	OK	-5,19%	0,00%	-27,00%	-	-
FII RB CAPITAL RENDA II	7.893.140,29	1,72%		137.234.072,15	5,75%	OK	OK	OK	2,82%	4,30%	14,06%	-5,19%	4,29%
Disponibilidades Financeiras	**168.693,65**	**0,04%**	-			-							

As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS que administra o plano e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade do RiskOffice, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação.

Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais o RiskOffice deposita confiança. Entretanto, o RiskOffice não se responsabiliza pela acurácia desses dados.

Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.