

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV**

**31/08/2015**

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades					
							RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>539.055.172,68</b>	<b>100,00%</b>	<b>161,00%</b>							<b>-1,91%</b>	<b>-0,73%</b>	<b>2,60%</b>	<b>3,03%</b>	<b>5,22%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>0,74%</b>	<b>3,10%</b>	<b>8,00%</b>	<b>16,47%</b>	<b>11,96%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>0,71%</b>	<b>3,13%</b>	<b>7,57%</b>	<b>16,10%</b>	<b>11,31%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>76.647.308,99</b>	<b>14,22%</b>	<b>20,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	76.647.308,99	14,22%								-2,44%	-2,18%	3,17%	9,40%	6,14%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>171.873.989,02</b>	<b>31,88%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	90.176.598,42	16,73%		3.859.928.140,21	2,34%	OK	OK	OK	-0,51%	2,02%	5,21%	10,74%	8,53%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	27.138.754,50	5,03%		1.694.384.289,47	1,60%	OK	OK	OK	-0,50%	2,05%	5,14%	10,60%	8,53%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	54.558.636,10	10,12%		918.972.334,85	5,94%	OK	OK	OK	-0,48%	2,11%	5,27%	10,89%	8,70%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>130.306.376,00</b>	<b>24,17%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	33.931.540,20	6,29%		1.172.057.752,08	2,90%	OK	OK	OK	-3,06%	-4,07%	0,50%	2,71%	4,11%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	59.661.948,97	11,07%		1.132.510.124,47	5,27%	OK	OK	OK	-0,52%	2,03%	5,18%	10,61%	8,49%	
BRADESCO FI RF IMA B	28.902.646,05	5,36%		1.038.086.029,93	2,78%	OK	OK	OK	-3,23%	-4,21%	0,44%	2,96%	4,14%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.412.914,53	1,00%		140.521.057,66	3,85%	OK	OK	OK	-0,76%	1,79%	4,99%	10,36%	8,21%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.397.326,25	0,44%		2.555.593.816,71	0,09%	OK	OK	OK	-2,96%	-4,19%	0,57%	3,26%	4,20%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>21.013.396,67</b>	<b>3,90%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.357.929,47	1,92%		6.035.060.462,88	0,17%	OK	OK	OK	1,11%	3,41%	6,55%	12,55%	8,45%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.485.210,73	1,39%		1.35.152.789,50	5,54%	OK	OK	OK	0,47%	2,37%	5,24%	9,22%	7,09%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	3.170.256,47	0,59%		4.289.575.593,61	0,07%	OK	OK	OK	1,05%	3,23%	6,15%	11,64%	7,90%	
<b>FIDC</b>	<b>5.046.891,37</b>	<b>0,94%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	5.046.891,37	0,94%		272.148.320,85	1,85%	OK	OK	OK	1,27%	3,90%	7,49%	14,32%	9,66%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>389.534,33</b>	<b>0,07%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	226.736,99	0,04%		5.290.539,14	4,29%	OK	OK	OK	-3,41%	-8,58%	-10,78%	183,23%	-10,26%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	162.797,34	0,03%		3.354.580,69	4,85%	OK	OK	OK	-1,35%	-	0,93%	-	-	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>25.537.135,51</b>	<b>4,74%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.244.586,51	1,71%		93.414.684,21	9,90%	OK	OK	OK	0,84%	3,36%	7,82%	15,23%	10,93%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.691.635,00	1,61%		96.085.182,30	9,05%	OK	OK	OK	1,02%	3,44%	8,18%	15,61%	11,21%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.600.914,00	1,41%		88.264.482,19	8,61%	OK	OK	OK	0,94%	3,34%	8,01%	15,73%	11,06%	
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>43.953.381,12</b>	<b>8,15%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.828.102,11	1,27%		57.694.244,42	11,83%	OK	OK	OK	-7,66%	-10,52%	-8,06%	-22,21%	-5,19%	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.611.464,00	0,86%		24.327.847,49	18,96%	OK	OK	OK	-5,85%	-6,21%	-3,47%	-14,25%	-1,89%	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.259.798,53	0,79%		24.636.957,81	17,29%	OK	OK	OK	-7,12%	-10,50%	-8,40%	-22,84%	-6,93%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.655.066,95	1,05%		506.320.798,89	1,12%	OK	OK	OK	-6,57%	-2,89%	2,89%	-16,40%	-2,62%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	22.598.949,53	4,19%		460.569.970,98	4,91%	OK	OK	OK	-6,67%	-7,99%	-6,13%	-18,56%	-5,44%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>			<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos de Ações</b>	<b>40.895.907,46</b>	<b>7,59%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	11.211.739,76	2,08%		133.973.477,11	8,37%	OK	OK	OK	-5,59%	-6,38%	-5,03%	-18,47%	-3,42%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.604.899,53	1,23%		1.492.780.466,95	0,44%	OK	OK	OK	-5,47%	-2,66%	2,47%	-2,10%	6,44%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	2.429.440,11	0,45%		659.037.328,15	0,37%	OK	OK	OK	-6,34%	-5,81%	-2,58%	-7,50%	2,04%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.807.754,21	0,89%		291.803.057,73	1,65%	OK	OK	OK	-7,33%	-8,67%	-8,02%	-12,24%	-8,30%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.654.352,20	0,68%		103.304.773,50	3,54%	OK	OK	OK	-9,96%	-11,61%	-15,82%	-6,83%	-15,09%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.327.467,04	0,43%		153.336.071,91	1,52%	OK	OK	OK	-6,38%	-7,11%	-6,83%	-18,07%	-6,44%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	9.860.254,61	1,83%		102.774.587,05	9,59%	OK	OK	OK	-3,09%	-3,66%	-0,92%	-18,55%	-8,28%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>4.480.516,22</b>	<b>0,83%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.554.750,51	0,47%		217.717.529,60	1,17%	OK	OK	OK	0,59%	4,08%	8,71%	13,71%	9,63%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	1.925.765,71	0,36%		214.005.359,02	0,90%	OK	OK	OK	-5,20%	-3,40%	-0,42%	10,34%	2,53%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>5.776.551,11</b>	<b>1,07%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	379.314,99	0,07%		171.334.934,81	0,22%	OK	OK	OK	7,83%	6,35%	4,33%	2,30%	2,66%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	942.717,48	0,17%		238.067.870,20	0,40%	OK	OK	OK	-0,54%	2,28%	-13,68%	-15,08%	-18,82%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.454.518,64	0,83%		31.627.082,34	14,08%	OK	OK	OK	-0,30%	-0,93%	-1,93%	-3,41%	-2,36%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>13.126.114,35</b>	<b>2,44%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	5.900.000,00	1,09%		191.185.854,91	3,09%	OK	OK	OK	-4,07%	-6,35%	-10,60%	-18,62%	-10,61%	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.226.114,35	1,34%		127.229.687,45	5,68%	OK	OK	OK	-0,94%	0,05%	-2,74%	-9,91%	0,76%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>8.070,53</b>	<b>0,001%</b>												

1 - As informações utilizadas na geração deste enquadramento foram obtidas junto ao RPPS que administra o plano e aos seus prestadores de serviços, não sendo de responsabilidade da Risk Office quaisquer erros decorrentes de ruídos ou falhas de informação;

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

3 - Adicionalmente, é preciso ressaltar que este relatório é confidencial, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não deve, portanto, ser utilizado para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização;

4 - Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.