

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

31/12/2015

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	
CONSOLIDADO	585.341.807,60	100,00%	161,00%							1,75%	4,38%	3,00%	9,64%	9,64%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,39%	4,31%	7,27%	17,95%	17,95%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,45%	4,32%	7,32%	17,31%	17,31%
Títulos Públicos	106.659.913,86	18,22%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	106.659.913,86	18,22%								1,60%	5,24%	3,21%	12,02%	12,02%
Fundos que contenham somente títulos públicos	181.738.747,44	31,05%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	108.270.788,96	18,50%		3.791.382.507,35	2,86%	OK	OK	OK	2,04%	5,10%	7,14%	14,86%	14,86%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	23.436.214,06	4,00%		1.649.982.018,06	1,42%	OK	OK	OK	2,08%	5,12%	7,21%	14,94%	14,94%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	50.031.744,42	8,55%		1.045.233.374,35	4,79%	OK	OK	OK	2,10%	5,17%	7,37%	15,24%	15,24%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	140.819.630,66	24,06%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	35.403.527,29	6,05%		901.755.196,20	3,93%	OK	OK	OK	1,50%	5,04%	0,39%	8,62%	8,62%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	67.041.497,80	11,45%		1.193.004.322,28	5,62%	OK	OK	OK	2,07%	5,10%	7,17%	14,87%	14,87%	
BRADERCO FI RF IMA B	30.150.861,71	5,15%		1.023.375.388,84	2,95%	OK	OK	OK	1,43%	5,06%	0,19%	8,64%	8,64%	
BRADERCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.725.323,16	0,98%		132.299.190,18	4,33%	OK	OK	OK	2,13%	5,17%	6,83%	14,45%	14,45%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.498.420,70	0,43%		2.360.710.492,14	0,11%	OK	OK	OK	1,21%	5,04%	0,07%	8,59%	8,59%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	25.811.523,42	4,41%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.826.155,64	1,85%		6.619.747.173,44	0,16%	OK	OK	OK	1,16%	3,36%	6,93%	13,35%	13,35%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.778.584,75	1,33%		127.921.111,73	6,08%	OK	OK	OK	1,28%	3,27%	5,20%	11,28%	11,28%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	7.206.783,03	1,23%		5.554.565.548,15	0,13%	OK	OK	OK	1,10%	3,17%	6,53%	12,48%	12,48%	
FIDC	5.309.268,48	0,91%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	5.309.268,48	0,91%		280.503.311,75	1,89%	OK	OK	OK	1,34%	3,87%	7,98%	15,36%	15,36%	
FIDC Fechado	357.092,24	0,06%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	213.052,22	0,04%		4.971.227,16	4,29%	OK	OK	OK	0,09%	-	-	-10,05%	-10,05%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	144.040,02	0,02%		2.895.248,33	4,98%	OK	OK	OK	-3,36%	-11,17%	-13,68%	-12,34%	-12,34%	
Fundo Crédito Privado	17.049.147,50	2,91%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.088.985,00	1,55%		100.477.815,34	9,05%	OK	OK	OK	1,48%	3,80%	6,90%	16,30%	16,30%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.960.162,50	1,36%		92.436.217,27	8,61%	OK	OK	OK	1,51%	3,92%	6,88%	16,31%	16,31%	
Fundos de Ações Referenciados	42.399.623,13	7,24%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.440.818,85	1,10%		36.647.516,29	17,58%	OK	OK	OK	-1,81%	-2,92%	-16,59%	-10,57%	-10,57%	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.489.874,23	0,77%		8.952.476,40	50,15%	OK	OK	Desenquadrado	-1,40%	-0,75%	-9,64%	-4,48%	-4,48%	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	3.920.054,71	0,67%		17.361.682,70	22,58%	OK	OK	OK	-4,03%	-3,73%	-17,98%	-14,35%	-14,35%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.846.928,91	1,00%		501.729.173,51	1,17%	OK	OK	OK	-1,14%	1,00%	-0,94%	0,69%	0,69%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	21.701.946,43	3,71%		422.194.003,62	5,14%	OK	OK	OK	-2,14%	-2,34%	-12,20%	-9,20%	-9,20%	
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	40.056.623,22	6,84%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	10.923.295,79	1,87%		112.353.695,94	9,72%	OK	OK	OK	-2,87%	-3,42%	-10,17%	-5,91%	-5,91%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.131.380,01	1,05%		939.279.255,50	0,65%	OK	OK	OK	-2,14%	-5,78%	-11,72%	-1,18%	-1,18%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	2.328.212,25	0,40%		359.283.844,93	0,65%	OK	OK	OK	-2,05%	-1,81%	-11,49%	-2,20%	-2,20%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.073.773,43	0,87%		307.949.066,22	1,65%	OK	OK	OK	0,11%	6,48%	-3,27%	-3,22%	-3,22%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.333.806,27	0,57%		81.320.748,70	4,10%	OK	OK	OK	-2,31%	-3,58%	-18,41%	-22,53%	-22,53%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.210.962,55	0,38%		120.397.305,19	1,84%	OK	OK	OK	-3,79%	-4,35%	-11,48%	-11,13%	-11,13%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.055.192,92	1,72%		93.313.248,81	10,78%	OK	OK	OK	-4,12%	0,60%	-0,67%	-6,47%	-6,47%	
Fundos Multimercados	4.769.186,95	0,81%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.663.906,54	0,46%		206.117.878,11	1,29%	OK	OK	OK	1,38%	2,32%	7,35%	14,32%	14,32%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.105.280,41	0,36%		188.384.804,92	1,12%	OK	OK	OK	0,31%	11,23%	6,65%	12,08%	12,08%	
Fundos de Participações	8.125.872,47	1,39%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	372.909,85	0,06%		168.441.754,93	0,22%	OK	OK	OK	-0,46%	-1,28%	5,24%	0,93%	0,93%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.789.383,25	0,31%		451.878.928,00	0,40%	OK	OK	OK	149,87%	90,84%	95,25%	54,08%	54,08%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.963.579,37	1,02%		42.341.413,55	14,08%	OK	OK	OK	0,62%	-	-	-0,94%	-0,94%	
Fundos de Investimento Imobiliários	12.163.001,17	2,08%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.850.000,00	1,00%		170.705.027,86	3,43%	OK	OK	OK	21,88%	12,50%	-7,14%	-11,37%	-11,37%	
FII RB CAPITAL RENDA II	6.313.001,17	1,08%		125.449.156,65	5,03%	OK	OK	OK	-7,12%	-6,71%	-11,04%	-9,86%	-9,86%	
Disponibilidades Financeiras	82.177,06	0,01%												

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.