

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV**

**30/06/2015**

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>538.091.713,44</b>	<b>100,00%</b>	<b>161,00%</b>							<b>0,59%</b>	<b>3,24%</b>	<b>6,62%</b>	<b>10,19%</b>	<b>6,62%</b>
<b>META ATUARIAL ( INPC + 6%)</b>										<b>1,26%</b>	<b>3,99%</b>	<b>9,96%</b>	<b>15,87%</b>	<b>9,96%</b>
<b>META ATUARIAL ( IPCA + 6%)</b>										<b>1,28%</b>	<b>3,76%</b>	<b>9,31%</b>	<b>15,43%</b>	<b>9,31%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>58.554.881,24</b>	<b>10,88%</b>	<b>20,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	58.554.881,24	10,88%								0,02%	3,96%	8,53%	13,86%	8,53%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>164.425.435,16</b>	<b>30,56%</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	83.743.158,38	15,56%		3.884.284.280,37	2,16%	OK	OK	OK	0,77%	2,92%	7,20%	11,78%	11,78%	7,20%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	26.810.693,81	4,98%		1.733.343.475,53	1,55%	OK	OK	OK	0,81%	2,86%	7,21%	11,61%	11,61%	7,21%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	53.871.582,97	10,01%		810.168.894,04	6,65%	OK	OK	OK	0,83%	2,91%	7,33%	11,88%	11,88%	7,33%
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>131.257.598,68</b>	<b>24,39%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	35.267.010,61	6,55%		1.439.833.804,14	2,45%	OK	OK	OK	-0,29%	4,82%	8,21%	13,16%	8,21%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	58.042.357,62	10,79%		838.085.805,37	6,93%	OK	OK	OK	0,80%	2,91%	7,18%	11,65%	7,18%	
BRADESCO FI RF IMA B	30.092.435,51	5,59%		1.060.209.893,98	2,84%	OK	OK	OK	-0,26%	4,95%	8,43%	13,55%	8,43%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.359.036,12	1,00%		66.662.140,37	8,04%	OK	OK	OK	0,78%	2,99%	7,13%	-	7,13%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.496.758,82	0,46%		2.635.834.390,11	0,09%	OK	OK	OK	-0,22%	4,68%	8,52%	13,49%	8,52%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>22.172.568,96</b>	<b>4,12%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.124.585,37	1,88%		5.832.199.246,04	0,17%	OK	OK	OK	1,08%	3,06%	6,01%	12,04%	6,01%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.394.009,33	1,37%		157.527.811,02	4,69%	OK	OK	OK	1,12%	3,20%	5,78%	9,65%	5,78%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	4.653.974,26	0,86%		4.002.463.169,91	0,12%	OK	OK	OK	1,01%	2,86%	5,59%	11,09%	5,59%	
<b>FIDC</b>	<b>4.916.844,49</b>	<b>0,91%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	4.916.844,49	0,91%		272.364.228,38	1,81%	OK	OK	OK	1,22%	3,49%	6,83%	13,69%	6,83%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>405.636,73</b>	<b>0,08%</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	238.774,74	0,04%		5.571.420,50	4,29%	OK	OK	OK	-3,72%	-3,61%	-5,50%	170,51%	-5,50%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	166.861,99	0,03%		3.353.976,94	4,98%	OK	OK	OK	-1,33%	2,48%	1,55%	27,23%	1,55%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>25.012.240,92</b>	<b>4,65%</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	9.062.007,42	1,68%		91.569.769,01	9,90%	OK	OK	OK	1,32%	3,63%	8,74%	14,42%	8,74%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.502.720,00	1,58%		93.996.741,61	9,05%	OK	OK	OK	1,20%	3,94%	8,80%	15,05%	8,80%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.447.513,50	1,38%		86.483.125,67	8,61%	OK	OK	OK	1,25%	3,89%	8,82%	15,09%	8,82%	
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>48.055.404,80</b>	<b>8,93%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.721.505,08	1,43%		66.293.197,06	11,65%	OK	OK	OK	1,19%	4,44%	7,22%	0,98%	7,22%	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.969.312,84	0,92%		27.440.682,71	18,11%	OK	OK	OK	1,07%	2,67%	5,72%	1,06%	5,72%	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.779.224,00	0,89%		26.502.964,83	18,03%	OK	OK	OK	0,42%	3,26%	4,42%	-0,43%	4,42%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.867.917,03	1,09%		540.164.909,38	1,09%	OK	OK	OK	1,37%	3,90%	1,65%	-9,96%	1,65%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	24.717.445,85	4,59%		486.150.926,00	5,08%	OK	OK	OK	0,64%	1,57%	3,42%	-0,80%	3,42%	
<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>43.688.022,30</b>	<b>8,12%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	12.159.393,88	2,26%		156.684.055,40	7,76%	OK	OK	OK	1,54%	1,64%	4,74%	1,18%	4,74%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.945.814,99	1,29%		1.434.583.419,43	0,48%	OK	OK	OK	2,37%	6,28%	11,93%	11,89%	11,93%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	2.630.684,99	0,49%		761.332.320,47	0,35%	OK	OK	OK	1,99%	3,47%	10,49%	6,71%	10,49%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.245.183,26	0,97%		318.352.569,76	1,65%	OK	OK	OK	-0,37%	1,20%	0,05%	-0,48%	0,05%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.085.832,76	0,76%		131.763.981,79	3,10%	OK	OK	OK	-1,18%	-0,96%	-5,06%	-18,19%	-5,06%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.497.651,31	0,46%		152.648.446,76	1,64%	OK	OK	OK	-0,32%	-1,90%	0,40%	-1,70%	0,40%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.123.461,11	1,88%		149.644.787,06	6,76%	OK	OK	OK	0,68%	-1,84%	-5,83%	-11,80%	-5,83%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>4.455.457,94</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	2.481.404,02	0,46%		218.493.802,03	1,14%	OK	OK	OK	1,09%	2,65%	6,49%	12,63%	6,49%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	1.974.053,92	0,37%		223.407.229,92	0,88%	OK	OK	OK	-0,98%	2,82%	5,10%	17,73%	5,10%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>5.558.117,61</b>	<b>1,03%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	231.090,32	0,04%		104.497.421,45	0,22%	OK	OK	OK	-0,66%	-1,89%	-4,10%	-6,27%	-4,10%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	916.450,91	0,17%		231.434.489,30	0,40%	OK	OK	OK	-0,57%	-15,68%	-21,09%	-16,67%	-21,09%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.410.576,38	0,82%		31.315.092,24	14,08%	OK	OK	OK	-0,48%	-1,02%	-1,92%	-3,50%	-1,92%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>13.531.511,00</b>	<b>2,51%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	6.300.000,00	1,17%		191.122.163,97	3,30%	OK	OK	OK	0,03%	3,28%	-4,55%	-18,18%	-4,55%	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.231.511,00	1,34%		127.701.048,43	5,66%	OK	OK	OK	0,62%	0,75%	1,33%	-5,63%	1,33%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>16.057.993,61</b>	<b>2,98%</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.