

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV**

**30/11/2015**

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>566.347.704,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>161,00%</b>							<b>0,52%</b>	<b>2,67%</b>	<b>1,98%</b>	<b>6,00%</b>	<b>8,09%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>1,60%</b>	<b>3,91%</b>	<b>7,13%</b>	<b>17,63%</b>	<b>16,33%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,50%</b>	<b>3,89%</b>	<b>7,14%</b>	<b>17,10%</b>	<b>15,64%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>104.991.189,05</b>	<b>18,54%</b>	<b>20,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PRÓPRIA SBCPREV	104.991.189,05	18,54%								0,91%	3,87%	1,61%	10,93%	10,25%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>163.367.293,10</b>	<b>28,85%</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	91.405.014,29	16,14%		3.693.337.240,60	2,47%	OK	OK	OK	0,55%	3,45%	5,81%	12,62%	12,56%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	22.957.697,64	4,05%		1.631.133.719,64	1,41%	OK	OK	OK	0,51%	3,50%	5,87%	12,60%	12,60%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	49.004.581,17	8,65%		986.557.543,08	4,97%	OK	OK	OK	0,53%	3,59%	6,03%	12,90%	12,87%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA</b>	<b>134.436.351,28</b>	<b>23,74%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	34.880.701,34	6,16%		901.110.215,67	3,87%	OK	OK	OK	1,02%	2,12%	-1,38%	4,97%	7,02%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	61.755.159,89	10,90%		1.150.167.990,03	5,37%	OK	OK	OK	0,52%	3,47%	5,83%	12,55%	12,53%	
BRADESCO FI RF IMA B	29.725.731,92	5,25%		1.000.474.517,49	2,97%	OK	OK	OK	1,04%	2,18%	-1,48%	5,06%	7,11%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.606.169,54	0,99%		125.376.151,32	4,47%	OK	OK	OK	0,53%	3,28%	5,43%	12,09%	12,07%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.468.588,59	0,44%		2.373.977.273,27	0,10%	OK	OK	OK	1,24%	2,37%	-1,35%	5,44%	7,29%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>23.576.561,59</b>	<b>4,16%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.701.655,17	1,89%		6.655.383.301,73	0,16%	OK	OK	OK	1,05%	3,37%	6,84%	13,14%	12,05%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.680.519,29	1,36%		127.643.931,41	6,02%	OK	OK	OK	0,97%	2,54%	5,04%	10,21%	9,88%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	5.194.387,13	0,92%		5.105.298.704,61	0,10%	OK	OK	OK	1,00%	3,17%	6,44%	12,26%	11,26%	
<b>FIDC</b>	<b>5.239.240,56</b>	<b>0,93%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.239.240,56	0,93%		276.803.543,22	1,89%	OK	OK	OK	1,21%	3,87%	7,86%	15,09%	13,84%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>366.981,86</b>	<b>0,06%</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	217.855,27	0,04%		5.083.298,67	4,29%	OK	OK	OK	-0,14%	-4,81%	-12,16%	-13,87%	-13,78%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	149.126,59	0,03%		2.997.269,08	4,98%	OK	OK	OK	-5,93%	-	-11,81%	-	-	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>26.351.228,58</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	9.553.101,58	1,69%		96.532.150,91	9,90%	OK	OK	OK	1,27%	3,37%	6,81%	15,88%	14,63%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.956.310,00	1,58%		99.011.136,55	9,05%	OK	OK	OK	1,21%	3,08%	6,59%	15,78%	14,60%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.841.817,00	1,38%		91.061.902,99	8,61%	OK	OK	OK	1,22%	3,21%	6,61%	15,79%	14,58%	
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>43.290.421,13</b>	<b>7,64%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.559.696,38	1,16%		37.334.793,33	17,57%	OK	OK	OK	-2,33%	-4,95%	-14,04%	-16,04%	-8,92%	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.554.025,04	0,80%		24.024.827,40	18,96%	OK	OK	OK	-0,63%	-2,65%	-7,38%	-8,86%	-3,12%	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.084.609,67	0,72%		18.090.473,67	22,58%	OK	OK	OK	-0,92%	-4,11%	-14,18%	-17,72%	-10,75%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.914.526,63	1,04%		512.942.417,54	1,15%	OK	OK	OK	2,78%	3,97%	1,57%	-5,79%	1,85%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	22.177.563,41	3,92%		432.759.917,92	5,12%	OK	OK	OK	-0,98%	-3,27%	-9,70%	-13,30%	-7,21%	
<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>41.155.662,05</b>	<b>7,27%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	11.246.379,12	1,99%		116.609.655,54	9,64%	OK	OK	OK	1,20%	-0,45%	-6,09%	-9,26%	-3,13%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.266.047,30	1,11%		1.444.220.839,65	0,43%	OK	OK	OK	-2,09%	-6,37%	-7,65%	-4,51%	0,98%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	2.377.235,20	0,42%		582.076.854,38	0,41%	OK	OK	OK	-1,59%	-3,46%	-7,83%	-4,90%	-0,16%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.067.981,74	0,89%		307.597.415,48	1,65%	OK	OK	OK	2,03%	3,81%	-3,73%	-3,84%	-3,33%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.412.713,42	0,60%		86.010.570,68	3,97%	OK	OK	OK	-6,17%	-7,39%	-17,46%	-27,57%	-20,70%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.298.095,92	0,41%		128.127.772,37	1,79%	OK	OK	OK	-1,01%	-2,19%	-8,28%	-13,26%	-7,62%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.487.209,35	1,85%		98.656.244,61	10,63%	OK	OK	OK	1,04%	6,07%	2,47%	-6,40%	-2,45%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>4.726.314,25</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	2.627.543,37	0,46%		208.572.662,25	1,26%	OK	OK	OK	1,51%	2,90%	7,05%	13,57%	12,76%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.098.770,88	0,37%		196.079.706,00	1,07%	OK	OK	OK	1,37%	7,95%	5,28%	13,37%	11,74%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>6.574.041,98</b>	<b>1,16%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	374.615,26	0,07%		169.212.078,10	0,22%	OK	OK	OK	-0,41%	-1,27%	5,03%	0,68%	1,39%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	716.112,50	0,13%		180.842.282,00	0,40%	OK	OK	OK	-0,66%	-24,06%	-22,31%	-35,80%	-38,34%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.483.314,22	0,97%		38.931.530,96	14,08%	OK	OK	OK	0,02%	1,36%	0,44%	-1,30%	-1,01%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>11.724.981,28</b>	<b>2,07%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FI RB CAPITAL RENDA II	6.924.981,28	1,22%		130.504.448,51	5,31%	OK	OK	OK	-2,46%	-4,08%	-3,63%	-1,29%	-2,95%	
DOMO FII	4.800.000,00	0,85%		191.410.289,31	2,51%	OK	OK	OK	-2,44%	-17,95%	-23,81%	-31,43%	-27,28%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>547.437,50</b>	<b>0,10%</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.