

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

30/10/2015

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	558.634.260,37	100,00%	161,00%							2,05%	0,19%	2,11%	7,58%	7,48%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,26%	3,03%	7,00%	16,95%	14,50%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,31%	3,08%	6,86%	16,53%	13,92%
Títulos Públicos	107.193.469,41	19,19%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA SBCPREV	107.193.469,41	19,19%								2,65%	0,42%	2,39%	11,08%	9,26%
Fundos que contenham somente títulos públicos	162.416.918,39	29,07%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	90.828.895,91	16,26%		3.593.804.948,31	2,53%	OK	OK	OK	2,43%	2,62%	7,00%	13,15%	11,94%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	22.840.278,88	4,09%		1.630.733.233,88	1,40%	OK	OK	OK	2,44%	2,70%	7,01%	13,17%	12,02%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	48.747.743,60	8,73%		971.454.138,10	5,02%	OK	OK	OK	2,47%	2,79%	7,20%	13,45%	12,28%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	129.292.319,95	23,14%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B	34.529.304,73	6,18%		923.089.696,51	3,74%	OK	OK	OK	2,44%	-1,35%	0,14%	6,07%	5,94%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	57.327.419,62	10,26%		1.118.575.406,06	5,13%	OK	OK	OK	2,43%	2,65%	7,02%	13,12%	11,95%	
BRADESCO FI RF IMA B	29.420.635,40	5,27%		1.006.382.558,36	2,92%	OK	OK	OK	2,51%	-1,50%	0,07%	6,49%	6,01%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.576.514,27	1,00%		115.292.554,96	4,84%	OK	OK	OK	2,43%	2,24%	6,64%	12,64%	11,48%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.438.445,93	0,44%		2.385.423.121,35	0,10%	OK	OK	OK	2,52%	-1,29%	-0,19%	6,26%	5,98%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	20.035.133,81	3,59%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.590.097,12	1,90%		6.566.406.853,04	0,16%	OK	OK	OK	1,11%	3,38%	6,78%	12,91%	10,88%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.606.703,45	1,36%		123.736.607,10	6,15%	OK	OK	OK	0,98%	2,10%	5,23%	10,00%	8,82%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	1.838.333,24	0,33%		4.760.970.669,20	0,04%	OK	OK	OK	1,04%	3,17%	6,36%	12,01%	10,16%	
FIDC	5.176.380,64	0,93%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	5.176.380,64	0,93%		279.130.893,96	1,85%	OK	OK	OK	1,27%	3,87%	7,77%	14,80%	12,47%	
FIDC Fechado	376.756,76	0,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	218.162,44	0,04%		5.090.465,97	4,29%	OK	OK	OK	-2,61%	-7,06%	-12,39%	-12,18%	-13,66%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	158.594,32	0,03%		3.187.794,17	4,98%	OK	OK	OK	-2,57%	-	-4,35%	-	-	
Fundo Crédito Privado	26.029.071,11	4,66%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.433.124,61	1,69%		95.319.796,52	9,90%	OK	OK	OK	1,17%	2,89%	6,54%	15,38%	13,19%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.848.985,00	1,58%		97.824.669,70	9,05%	OK	OK	OK	1,06%	2,85%	6,50%	15,35%	13,23%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.746.961,50	1,39%		89.960.427,62	8,61%	OK	OK	OK	1,13%	2,88%	6,46%	15,33%	13,19%	
Fundos de Ações Referenciados	43.572.342,27	7,80%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.716.239,85	1,20%		38.527.887,29	17,43%	OK	OK	OK	1,23%	-9,18%	-15,70%	-14,51%	-6,74%	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.582.799,31	0,82%		24.176.628,58	18,96%	OK	OK	OK	1,29%	-6,44%	-10,27%	-6,43%	-2,50%	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.122.639,81	0,74%		22.009.981,36	18,73%	OK	OK	OK	1,25%	-10,11%	-18,58%	-15,87%	-9,92%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.754.386,28	1,03%		502.928.607,02	1,14%	OK	OK	OK	-0,60%	-4,93%	-4,49%	-5,69%	-0,91%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	22.396.277,02	4,01%		448.431.067,91	4,99%	OK	OK	OK	0,78%	-7,50%	-13,16%	-10,92%	-6,29%	
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	41.233.236,62	7,38%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	11.112.625,98	1,99%		115.780.370,79	9,60%	OK	OK	OK	-1,75%	-6,42%	-11,16%	-8,38%	-4,28%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.999.840,14	1,15%		1.452.422.146,28	0,44%	OK	OK	OK	-1,66%	-8,41%	-8,31%	0,39%	3,13%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	2.415.703,66	0,43%		608.223.190,53	0,40%	OK	OK	OK	1,87%	-6,87%	-9,69%	-0,31%	1,46%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.967.050,93	0,89%		301.471.481,76	1,65%	OK	OK	OK	4,24%	-4,26%	-5,75%	-4,91%	-5,26%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.637.083,11	0,65%		95.197.080,02	3,82%	OK	OK	OK	5,19%	-10,38%	-18,34%	-24,13%	-15,49%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.321.499,15	0,42%		135.702.613,58	1,71%	OK	OK	OK	0,43%	-6,62%	-13,33%	-12,22%	-6,68%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.379.433,65	1,86%		100.935.498,54	10,28%	OK	OK	OK	3,85%	2,01%	-0,48%	-7,03%	-3,45%	
Fundos Multimercados	4.658.866,88	0,83%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.588.421,51	0,46%		212.530.105,51	1,22%	OK	OK	OK	-0,58%	1,91%	6,56%	14,03%	11,08%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.070.445,37	0,37%		199.429.544,83	1,04%	OK	OK	OK	9,39%	1,93%	6,10%	15,69%	10,23%	
Fundos de Participações	6.580.668,29	1,18%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	376.149,42	0,07%		169.905.054,94	0,22%	OK	OK	OK	-0,42%	6,94%	4,81%	3,51%	1,80%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	720.860,22	0,13%		182.041.238,60	0,40%	OK	OK	OK	-23,12%	-23,94%	-22,20%	-35,56%	-37,93%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.483.658,65	0,98%		38.933.976,44	14,08%	OK	OK	OK	1,65%	1,08%	0,18%	-1,54%	-1,01%	
Fundos de Investimento Imobiliários	12.039.260,68	2,16%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.920.000,00	0,88%		191.335.494,32	2,57%	OK	OK	OK	-5,38%	-20,00%	-16,61%	-31,28%	-25,46%	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.119.260,68	1,27%		124.018.099,85	5,74%	OK	OK	OK	2,97%	-2,17%	-1,81%	-11,51%	-0,50%	
Disponibilidades Financeiras	29.835,56	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.