

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

30/09/2015

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	543.444.461,07	100,00%	161,00%							0,02%	-1,23%	1,98%	7,02%	5,31%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,00%	2,83%	6,94%	16,50%	13,07%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,03%	2,87%	6,74%	16,06%	12,45%
Títulos Públicos	104.423.439,80	19,22%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	104.423.439,80	19,22%								0,28%	-1,93%	1,96%	8,99%	6,44%
Fundos que contenham somente títulos públicos	155.836.841,22	28,68%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	85.967.942,39	15,82%		3.425.801.215,68	2,51%	OK	OK	OK	0,70%	1,95%	4,92%	11,53%	9,29%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	22.295.254,20	4,10%		1.599.833.756,41	1,39%	OK	OK	OK	0,76%	1,99%	4,90%	11,47%	9,35%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	47.573.644,63	8,75%		881.890.086,93	5,39%	OK	OK	OK	0,81%	2,09%	5,06%	11,79%	9,57%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	125.742.358,41	23,14%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	33.705.436,39	6,20%		929.372.251,93	3,63%	OK	OK	OK	-0,67%	-4,43%	0,18%	5,75%	3,41%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	55.514.807,16	10,22%		1.076.382.657,16	5,16%	OK	OK	OK	0,74%	1,96%	4,93%	11,45%	9,29%	
BRADESCO FI RF IMA B	28.699.620,71	5,28%		1.000.751.729,82	2,87%	OK	OK	OK	-0,70%	-4,63%	0,09%	6,09%	3,41%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.443.964,51	1,00%		90.470.920,47	6,02%	OK	OK	OK	0,57%	1,58%	4,62%	11,11%	8,83%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.378.529,64	0,44%		2.358.460.633,60	0,10%	OK	OK	OK	-0,78%	-4,74%	-0,28%	5,84%	3,38%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	19.875.676,92	3,66%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.474.225,14	1,93%		6.598.035.938,54	0,16%	OK	OK	OK	1,12%	3,45%	6,62%	12,75%	9,67%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.532.574,70	1,39%		128.981.438,85	5,84%	OK	OK	OK	0,63%	1,87%	5,13%	9,43%	7,76%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	1.868.877,08	0,34%		4.542.511.938,58	0,04%	OK	OK	OK	1,05%	3,26%	6,21%	11,84%	9,03%	
FIDC	5.111.219,84	0,94%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.111.219,84	0,94%		275.617.166,22	1,85%	OK	OK	OK	1,27%	3,95%	7,58%	14,59%	11,06%	
FIDC Fechado	386.159,04	0,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	224.005,35	0,04%		5.226.800,67	4,29%	OK	OK	OK	-1,20%	-6,19%	-9,57%	-9,61%	-11,34%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	162.153,69	0,03%		3.259.338,68	4,98%	OK	OK	OK	-2,84%	-2,82%	-0,41%	1669,33%	-1,31%	
Fundo Crédito Privado	25.740.527,54	4,74%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.323.953,04	1,72%		94.216.664,70	9,90%	OK	OK	OK	0,86%	2,89%	6,63%	15,24%	11,88%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.756.355,00	1,61%		96.800.622,93	9,05%	OK	OK	OK	0,74%	2,98%	7,04%	15,39%	12,04%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.660.219,50	1,41%		88.953.132,23	8,61%	OK	OK	OK	0,78%	2,86%	6,86%	15,26%	11,93%	
Fundos de Ações Referenciados	43.242.026,37	7,96%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.634.716,22	1,22%		38.060.224,86	17,43%	OK	OK	OK	-2,83%	-14,07%	-10,26%	-14,74%	-7,88%	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.524.244,08	0,83%		23.867.717,35	18,96%	OK	OK	OK	-1,89%	-8,96%	-6,52%	-6,36%	-3,75%	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.071.786,44	0,75%		23.135.587,77	17,60%	OK	OK	OK	-4,41%	-14,80%	-12,02%	-16,81%	-11,03%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.788.927,46	1,07%		509.892.656,82	1,14%	OK	OK	OK	2,37%	-1,93%	1,90%	-6,46%	-0,31%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	22.222.352,17	4,09%		448.258.525,40	4,96%	OK	OK	OK	-1,67%	-10,09%	-8,68%	-10,13%	-7,02%	
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	40.718.705,91	7,49%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	11.310.075,65	2,08%		119.117.429,56	9,49%	OK	OK	OK	0,88%	-6,98%	-5,46%	-7,60%	-2,58%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.507.995,63	1,20%		1.458.410.132,34	0,45%	OK	OK	OK	-1,47%	-6,30%	-0,42%	6,47%	4,88%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	2.371.376,67	0,44%		605.575.531,17	0,39%	OK	OK	OK	-2,39%	-9,86%	-6,72%	-0,69%	-0,40%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.765.027,87	0,88%		289.209.919,35	1,65%	OK	OK	OK	-0,89%	-9,15%	-8,07%	-6,77%	-9,11%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.457.741,43	0,64%		92.909.872,37	3,72%	OK	OK	OK	-5,38%	-15,31%	-16,19%	-30,76%	-19,65%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.311.455,37	0,43%		145.769.504,83	1,59%	OK	OK	OK	-0,69%	-7,45%	-9,22%	-12,04%	-7,09%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	9.995.033,29	1,84%		98.519.905,55	10,15%	OK	OK	OK	1,37%	-1,27%	-3,08%	-10,34%	-7,03%	
Fundos Multimercados	4.496.206,06	0,83%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.603.494,82	0,48%		216.172.142,08	1,20%	OK	OK	OK	1,91%	4,92%	7,70%	16,23%	11,73%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	1.892.711,24	0,35%		190.203.773,66	1,00%	OK	OK	OK	-1,72%	-4,12%	-1,42%	9,18%	0,77%	
Fundos de Participações	5.758.028,74	1,06%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	377.740,91	0,07%		170.623.927,00	0,22%	OK	OK	OK	-0,41%	6,60%	4,59%	2,92%	2,23%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	937.613,87	0,17%		236.778.765,80	0,40%	OK	OK	OK	-0,54%	2,31%	-13,73%	-16,43%	-19,26%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.442.673,96	0,82%		31.542.985,13	14,08%	OK	OK	OK	-0,27%	-0,71%	-1,72%	-3,41%	-2,62%	
Fundos de Investimento Imobiliários	12.097.998,03	2,23%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.200.000,00	0,96%		191.246.594,40	2,72%	OK	OK	OK	-11,86%	-17,46%	-14,75%	-27,78%	-21,22%	
FII RB CAPITAL RENDA II	6.897.998,03	1,27%		127.576.452,57	5,41%	OK	OK	OK	-4,10%	-4,64%	-3,92%	-14,24%	-3,37%	
Disponibilidades Financeiras	15.273,19	0,003%												

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.