

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

29/04/2016

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	656.857.545,36	100,00%	211,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)									2,66%	8,00%	12,06%	14,31%	9,56%		
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									1,13%	3,54%	8,80%	16,42%	5,62%		
									1,10%	3,45%	8,40%	15,84%	5,27%		
Títulos Públicos	121.734.684,19	18,53%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A					Alocação:	Enquadrado			
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	121.734.684,19	18,53%							3,60%	12,10%	17,27%	20,07%	14,38%		
Fundos que contenham somente títulos públicos	209.155.703,56	31,84%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado			
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	5.307.040,23	0,81%		49.076.596,43	10,81%	OK	OK	OK	3,96%	11,49%	16,64%	17,56%	13,44%		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	125.136.371,07	19,05%		4.861.854.444,38	2,57%	OK	OK	OK	1,53%	3,82%	9,63%	17,30%	6,84%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	25.225.957,25	3,84%		1.988.823.157,16	1,27%	OK	OK	OK	1,51%	3,78%	9,61%	17,29%	6,82%		
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	53.486.335,01	8,14%		1.373.563.086,54	3,89%	OK	OK	OK	1,52%	3,84%	9,72%	17,62%	6,90%		
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	170.465.812,67	25,95%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado			
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	40.273.904,02	6,13%		936.173.791,27	4,30%	OK	OK	OK	3,89%	11,66%	16,64%	16,80%	13,76%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	75.672.482,09	11,52%		1.615.147.667,93	4,69%	OK	OK	OK	1,55%	3,86%	9,71%	17,40%	6,92%		
BRADESCO FI RF IMA B	34.285.291,16	5,22%		1.051.744.598,04	3,26%	OK	OK	OK	4,08%	11,74%	16,53%	16,62%	13,71%		
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	17.404.461,20	2,65%		222.235.586,60	7,83%	OK	OK	OK	1,66%	3,96%	9,90%	17,20%	7,05%		
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.829.674,20	0,43%		2.261.669.065,17	0,13%	OK	OK	OK	3,66%	11,42%	16,04%	15,83%	13,26%		
Fundos de Renda Fixa (Normal)	25.710.762,32	3,91%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado			
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.292.168,59	1,72%		6.254.880.112,52	0,18%	OK	OK	OK	1,04%	3,22%	6,63%	13,86%	4,30%		
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	8.211.176,22	1,25%		138.849.849,39	5,91%	OK	OK	OK	1,74%	3,92%	7,95%	13,59%	5,56%		
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	6.207.417,51	0,95%		7.484.538.892,13	0,08%	OK	OK	OK	1,00%	3,02%	6,23%	12,99%	4,03%		
FIDC	5.575.123,29	0,85%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado			
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.575.123,29	0,85%		307.121.963,03	1,82%	OK	OK	OK	1,21%	3,75%	7,70%	16,08%	5,01%		
FIDC Fechado	375.781,58	0,06%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado			
FIDC MULTISERIAL BVA MASTER II SENIOR	245.014,98	0,04%		5.717.026,22	4,29%	OK	OK	OK	8,18%	16,15%	12,31%	-1,60%	15,00%		
FIDC TREND BANK MULTISERIAL 2 SEN	130.766,60	0,02%		2.628.448,47	4,98%	OK	OK	OK	-2,23%	-	-17,59%	-21,14%	-9,16%		
Fundo Crédito Privado	17.938.071,50	2,73%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:	Enquadrado			
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.565.475,00	1,46%		105.745.372,12	9,05%	OK	OK	OK	0,94%	3,80%	8,10%	15,12%	5,24%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.372.596,50	1,27%		97.225.511,71	8,61%	OK	OK	OK	0,91%	3,76%	8,08%	15,06%	5,18%		
Fundos de Ações Referenciados	38.283.948,67	5,83%	15,00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado			
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.648.124,45	1,16%		35.714.042,09	21,41%	OK	OK	OK	8,20%	27,96%	13,88%	-4,01%	18,74%		
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.337.125,27	0,81%		451.781.669,58	1,18%	OK	OK	OK	2,59%	-0,76%	-7,25%	-11,42%	-8,72%		
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	25.298.698,95	3,85%		476.650.663,82	5,31%	OK	OK	OK	5,64%	20,82%	12,96%	-1,91%	16,57%		
Fundos de Índices de Ações	4.850.753,46	0,74%	2,00%			Art. 8o, Inciso II					Alocação:	Enquadrado			
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.850.753,46	0,74%		22.540.277,69	21,52%	OK	OK	OK	7,66%	32,61%	17,66%	-4,20%	23,74%		
Fundos de Ações	38.299.720,37	5,83%	15,00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado			
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.907.307,77	0,44%		248.980.643,16	1,17%	OK	OK	OK	1,41%	-2,78%	-8,62%	-12,65%	-8,43%		
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	12.793.037,31	1,95%		113.344.209,24	11,29%	OK	OK	OK	6,28%	26,69%	15,12%	2,27%	17,12%		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.450.747,93	0,83%		330.829.196,84	1,65%	OK	OK	OK	3,42%	10,76%	9,74%	3,42%	7,43%		
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.971.350,51	0,60%		118.427.656,11	3,35%	OK	OK	OK	8,30%	29,75%	9,19%	-10,84%	19,12%		
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.474.460,63	0,38%		126.939.507,95	1,95%	OK	OK	OK	4,43%	15,68%	6,59%	-7,62%	11,92%		
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.702.816,22	1,63%		90.971.303,15	11,77%	OK	OK	OK	4,52%	6,89%	3,12%	2,62%	6,44%		
Fundos Multimercados	4.847.406,74	0,74%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Enquadrado			
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.666.101,79	0,41%		176.824.580,82	1,51%	OK	OK	OK	0,50%	-0,72%	3,00%	9,76%	0,08%		
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.181.304,95	0,33%		138.239.755,91	1,58%	OK	OK	OK	1,23%	10,22%	5,35%	11,78%	3,61%		
Fundos de Participações	7.330.929,60	1,12%	5,00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado			
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	538.893,24	0,08%		242.868.015,83	0,22%	OK	OK	OK	4,65%	4,31%	2,97%	7,92%	3,87%		
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.372.980,32	0,21%		346.723.303,80	0,40%	OK	OK	OK	-0,18%	-4,44%	136,70%	84,21%	-4,64%		
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.419.056,04	0,82%		38.475.297,94	14,08%	OK	OK	OK	0,11%	-19,01%	-8,95%	-8,79%	-9,13%		
Fundos de Investimento Imobiliários	12.217.696,18	1,86%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado			
DOMO FII	5.800.000,00	0,88%		170.606.532,68	3,40%	OK	OK	OK	0,17%	8,41%	17,89%	-1,69%	-0,85%		
FII RB CAPITAL RENDA II	6.417.696,18	0,98%		126.921.299,56	5,06%	OK	OK	OK	1,64%	16,57%	-9,64%	-11,27%	-0,25%		
Disponibilidades Financeiras	71.151,23	0,011%													

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.