

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV**

**31/08/2016**

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>711.958.637,53</b>	<b>100,00%</b>	<b>211,00%</b>							<b>1,04%</b>	<b>5,39%</b>	<b>10,91%</b>	<b>19,69%</b>	<b>14,64%</b>
<b>META ATUARIAL ( INPC + 6%)</b>										<b>0,80%</b>	<b>2,91%</b>	<b>6,59%</b>	<b>16,20%</b>	<b>10,29%</b>
<b>META ATUARIAL ( IPCA + 6%)</b>										<b>0,93%</b>	<b>2,80%</b>	<b>6,22%</b>	<b>15,51%</b>	<b>9,60%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>124.539.111,86</b>	<b>17,49%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PRÓPRIA SBCPREV	124.539.111,86	17,49%								1,25%	5,01%	11,90%	19,93%	17,06%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>216.129.555,00</b>	<b>30,36%</b>	<b>50,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	10.708.835,58	1,50%		63.702.835,45	16,81%	OK	OK	OK	0,67%	5,00%	14,29%	24,94%	19,00%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	139.777.637,84	19,63%		5.821.830.490,52	2,40%	OK	OK	OK	1,07%	3,21%	6,38%	17,61%	11,13%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	5.842.015,58	0,82%		2.141.229.623,60	0,27%	OK	OK	OK	1,06%	3,17%	6,29%	17,62%	11,05%	
SAFRA IMA FIC FI RF	5.132.406,12	0,72%		246.904.584,88	2,08%	OK	OK	OK	0,80%	5,14%	13,68%	23,74%	18,12%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	54.668.659,88	7,68%		1.656.473.815,57	3,30%	OK	OK	OK	1,10%	3,22%	6,40%	17,90%	11,21%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>199.390.674,12</b>	<b>28,01%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	75.781.817,68	10,64%		2.318.867.463,76	3,27%	OK	OK	OK	1,11%	3,23%	6,45%	17,79%	11,25%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	42.376.732,92	5,95%		1.113.831.021,21	3,80%	OK	OK	OK	0,98%	5,37%	14,95%	24,89%	19,70%	
BRDESCO INST FIC FI RF IMA B	39.219.415,75	5,51%		1.106.731.938,87	3,54%	OK	OK	OK	0,92%	5,43%	15,13%	24,88%	19,71%	
BRDESCO INST FIC FI RF IMA B 5	18.084.916,62	2,54%		307.534.238,01	5,88%	OK	OK	OK	1,07%	3,14%	6,40%	17,65%	11,23%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	23.927.791,15	3,36%		2.344.278.875,66	1,02%	OK	OK	OK	0,97%	5,35%	14,94%	24,37%	19,34%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>50.445.818,68</b>	<b>7,09%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	8.585.805,36	1,21%		216.294.412,17	3,97%	OK	OK	OK	1,27%	3,80%	7,74%	14,70%	10,38%	
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	11.826.710,04	1,66%		6.828.341.137,40	0,17%	OK	OK	OK	1,22%	3,57%	7,04%	14,18%	9,24%	
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	24.080.594,46	3,38%		1.118.927.964,08	2,15%	OK	OK	OK	0,92%	4,67%	12,46%	20,17%	15,95%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	5.952.708,82	0,84%		8.676.857.514,09	0,07%	OK	OK	OK	1,14%	3,34%	6,59%	13,25%	8,64%	
<b>FIDC</b>	<b>5.875.515,96</b>	<b>0,83%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.875.515,96	0,83%		316.841.520,61	1,85%	OK	OK	OK	1,40%	4,06%	8,09%	16,42%	10,67%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>150.730,04</b>	<b>0,02%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC MULTISERIAL BVA MASTER II SENIOR	45.617,62	0,01%		1.064.412,89	4,29%	OK	OK	OK	20,95%	-64,54%	-80,15%	-79,88%	-78,59%	
FIDC TREND BANK MULTISERIAL 2 SEN	105.112,42	0,01%		2.014.940,97	5,22%	OK	OK	OK	-11,83%	-18,53%	-26,40%	-39,93%	-30,41%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>41.911.044,52</b>	<b>5,89%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	8.329.315,91	1,17%		35.436.398,94	23,50%	OK	OK	OK	2,50%	18,29%	32,57%	21,99%	29,32%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.721.349,60	0,80%		489.198.882,99	1,17%	OK	OK	OK	0,82%	16,67%	4,15%	1,17%	-2,15%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	27.860.379,01	3,91%		468.226.200,22	5,95%	OK	OK	OK	-0,06%	15,93%	27,75%	23,28%	28,38%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>5.201.828,56</b>	<b>0,73%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.201.828,56	0,73%		28.491.064,78	18,26%	OK	OK	OK	0,79%	18,77%	34,59%	22,11%	32,70%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>42.163.221,68</b>	<b>5,92%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	14.258.411,55	2,00%		128.298.539,13	11,11%	OK	OK	OK	4,02%	25,59%	32,30%	27,17%	30,53%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.737.968,19	0,38%		133.650.883,88	2,05%	OK	OK	OK	1,67%	20,20%	25,65%	17,64%	23,84%	
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	11.964.849,17	1,68%		131.739.478,43	9,08%	OK	OK	OK	-1,95%	13,15%	18,53%	21,34%	18,99%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.727.785,49	0,80%		347.643.709,09	1,65%	OK	OK	OK	0,87%	8,68%	12,92%	19,14%	12,89%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.078.063,75	0,43%		279.260.283,64	1,10%	OK	OK	OK	1,63%	15,11%	0,61%	-2,32%	-3,05%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.396.143,53	0,62%		122.406.858,31	3,59%	OK	OK	OK	1,35%	22,36%	36,75%	20,30%	31,87%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>5.187.998,63</b>	<b>0,73%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.789.865,38	0,39%		150.999.169,12	1,85%	OK	OK	OK	0,88%	3,58%	3,75%	9,20%	4,73%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.398.133,25	0,34%		136.647.968,99	1,75%	OK	OK	OK	1,12%	6,96%	19,58%	24,53%	13,91%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>8.495.467,27</b>	<b>1,19%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	505.155,81	0,07%		227.663.255,64	0,22%	OK	OK	OK	-5,90%	-6,12%	-1,83%	-4,28%	-2,64%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	850.720,80	0,12%		214.835.363,80	0,40%	OK	OK	OK	-6,46%	-16,65%	-20,40%	52,03%	-19,90%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	7.139.590,66	1,00%		50.691.093,66	14,08%	OK	OK	OK	0,14%	-6,20%	5,43%	-8,78%	-10,20%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>12.223.772,37</b>	<b>1,72%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.003.772,37	0,98%		128.022.571,77	5,47%	OK	OK	OK	3,08%	7,24%	26,47%	-2,61%	8,86%	
DOMO FII	5.220.000,00	0,73%		175.308.174,56	2,98%	OK	OK	OK	-2,43%	-11,53%	-10,00%	-11,53%	-10,77%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>243.898,84</b>	<b>0,034%</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.