

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

30/12/2016

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
RF	648.034.215,50	84,09%	164,00%						2,92%	3,28%	7,74%	19,21%	19,21%
RV	122.477.844,04	15,89%	47,00%						-1,18%	1,18%	11,61%	21,38%	21,38%
CONSOLIDADO	770.643.407,80	100,00%	211,00%						2,27%	3,17%	8,65%	20,00%	20,00%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,63%	1,85%	4,42%	12,97%	12,97%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,79%	2,22%	4,80%	12,67%	12,67%
Títulos Públicos	157.042.128,08	20,38%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA SBCPREV	157.042.128,08	20,38%							2,99%	2,59%	7,49%	21,96%	21,96%
Fundos que contenham somente títulos públicos	238.735.780,68	30,98%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M FI	1.403.006,15	0,18%		3.466.342.099,07	0,04%	OK	OK	OK	1,81%	3,35%	7,81%	23,21%	23,21%
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	12.170.480,92	1,58%		67.083.609,11	18,14%	OK	OK	OK	2,83%	2,39%	7,58%	23,98%	23,98%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	65.722.731,79	8,53%		1.520.412.873,64	4,32%	OK	OK	OK	1,81%	3,41%	7,88%	23,26%	23,26%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	98.308.845,16	12,76%		5.450.485.822,27	1,80%	OK	OK	OK	1,38%	2,23%	6,01%	15,19%	15,19%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.050.992,53	0,79%		1.893.493.369,33	0,32%	OK	OK	OK	1,36%	2,17%	5,90%	15,02%	15,02%
SAFRA IMA FIC FI RF	8.541.589,39	1,11%		347.599.459,09	2,46%	OK	OK	OK	2,75%	2,10%	7,10%	22,47%	22,47%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	46.538.134,74	6,04%		1.331.744.011,26	3,49%	OK	OK	OK	1,38%	2,22%	6,01%	15,27%	15,27%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	186.248.603,13	24,17%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B 5 LP FC	58.258.209,78	7,56%		1.970.956.693,10	2,96%	OK	OK	OK	1,36%	2,20%	6,01%	15,28%	15,28%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B FI	44.864.418,86	5,82%		1.109.454.048,62	4,04%	OK	OK	OK	2,88%	2,30%	7,59%	24,46%	24,46%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	40.836.783,49	5,30%		1.271.470.620,48	3,21%	OK	OK	OK	3,00%	2,42%	7,69%	24,64%	24,64%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	23.846.656,38	3,09%		280.924.433,97	8,49%	OK	OK	OK	1,42%	2,25%	6,01%	15,33%	15,33%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	18.442.534,62	2,39%		2.286.107.718,62	0,81%	OK	OK	OK	2,80%	2,48%	7,53%	24,14%	24,14%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	59.263.672,43	7,69%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	11.865.056,70	1,54%		181.849.739,25	6,52%	OK	OK	OK	1,38%	2,08%	5,69%	13,76%	13,76%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.369.293,38	1,61%		7.364.690.538,54	0,17%	OK	OK	OK	1,12%	3,45%	7,06%	14,25%	14,25%
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	30.331.762,01	3,94%		1.223.348.136,08	2,48%	OK	OK	OK	2,12%	2,91%	7,50%	21,48%	21,48%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	4.697.560,34	0,61%		8.642.263.777,66	0,05%	OK	OK	OK	1,06%	3,07%	6,44%	13,14%	13,14%
FIDC	6.169.271,30	0,80%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	6.169.271,30	0,80%		341.294.642,28	1,81%	OK	OK	OK	1,29%	3,74%	7,89%	16,27%	16,27%
FIDC Fechado	574.759,88	0,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	458.104,23	0,06%		10.689.117,45	4,29%	OK	OK	OK	1116,38%	992,85%	7392,99%	14873,73%	14873,73%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	116.655,65	0,02%		2.344.814,09	4,98%	OK	OK	OK	-3,64%	-8,37%	-3,35%	-19,01%	-19,01%
Fundo Crédito Privado			5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações Referenciados	45.004.400,08	5,84%	15,00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	8.732.920,37	1,13%		36.759.407,24	23,76%	OK	OK	OK	-1,40%	3,47%	18,12%	35,59%	35,59%
GERAÇÃO FIA PROGRAMADO	8.156.654,37	1,06%		522.144.503,14	1,56%	OK	OK	OK	1,42%	6,30%	19,67%	5,01%	5,01%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	28.114.825,34	3,65%		481.259.581,68	5,84%	OK	OK	OK	-1,50%	1,13%	10,86%	29,55%	29,55%
Fundos de Índices de Ações	5.423.297,71	0,70%	2,00%			Art. 8o, Inciso II					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.423.297,71	0,70%		24.547.224,87	22,09%	OK	OK	OK	-2,69%	3,24%	16,78%	38,35%	38,35%
Fundos de Ações	46.995.949,72	6,10%	15,00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	16.426.214,83	2,13%		122.233.588,40	13,44%	OK	OK	OK	-4,40%	1,95%	19,65%	32,55%	32,55%
AZ QUEST ACOES FC FIA	4.711.889,16	0,61%		106.800.985,65	4,41%	OK	OK	OK	-1,78%	1,93%	17,71%	25,97%	25,97%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	12.074.593,29	1,57%		143.257.865,60	8,43%	OK	OK	OK	2,26%	2,38%	9,05%	20,08%	20,08%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.701.541,26	0,74%		346.050.816,64	1,65%	OK	OK	OK	-0,53%	-0,47%	5,55%	12,37%	12,37%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.122.995,48	0,41%		264.031.286,09	1,18%	OK	OK	OK	2,22%	0,52%	12,40%	-1,64%	-1,64%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.958.715,70	0,64%		132.355.463,52	3,75%	OK	OK	OK	-0,77%	13,81%	28,73%	48,74%	48,74%
Fundos Multimercados	5.495.894,85	0,71%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Enquadrado	
GERAÇÃO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.911.049,05	0,38%		134.932.165,03	2,16%	OK	OK	OK	0,70%	3,49%	6,49%	9,28%	9,28%
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.584.845,80	0,34%		138.540.096,97	1,87%	OK	OK	OK	3,16%	6,94%	14,05%	22,78%	22,78%
Fundos de Participações	7.705.894,67	1,00%	5,00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	503.221,52	0,07%		226.791.506,10	0,22%	OK	OK	OK	-0,10%	-0,28%	-6,40%	-3,01%	-3,01%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	832.050,10	0,11%		210.120.389,30	0,40%	OK	OK	OK	-0,60%	-1,65%	-3,60%	-18,20%	-18,20%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.370.623,05	0,83%		45.231.423,61	14,08%	OK	OK	OK	-0,24%	-11,58%	-10,96%	-20,39%	-20,39%
Fundos de Investimento Imobiliários	11.852.407,01	1,54%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.840.000,00	0,63%		162.124.042,52	2,99%	OK	OK	OK	-11,52%	-21,94%	-6,91%	-17,26%	-17,26%
FII RB CAPITAL RENDA II	7.012.407,01	0,91%		125.453.684,08	5,59%	OK	OK	OK	1,91%	1,64%	8,15%	9,06%	9,06%
Disponibilidades Financeiras	131.348,26	0,017%											

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.