

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

29/02/2016

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	611.330.873,48	100,00%	211,00%															
META ATUARIAL (INPC + 6%)																		
META ATUARIAL (IPCA + 6%)																		
Títulos Públicos	111.558.605,83	18,25%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A												
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	111.558.605,83	18,25%																
Fundos que contenham somente títulos públicos	193.167.751,05	31,60%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B												
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	116.200.568,06	19,01%		4.402.467.701,92	2,64%	OK	OK	OK	1,51%	6,60%	10,56%	16,32%	16,32%	4,47%				
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	24.673.043,48	4,04%		1.859.358.727,98	1,33%	OK	OK	OK	1,50%	6,66%	10,66%	16,35%	16,35%	4,48%				
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	52.294.139,51	8,55%		1.286.007.051,87	4,07%	OK	OK	OK	1,52%	6,71%	10,81%	16,65%	16,65%	4,52%				
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	160.803.455,21	26,30%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A												
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	36.865.928,65	6,03%		853.933.240,91	4,32%	OK	OK	OK	2,21%	5,69%	8,65%	9,19%	4,13%					
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	72.996.767,71	11,94%		1.405.005.538,60	5,20%	OK	OK	OK	1,52%	6,67%	10,65%	16,38%	16,38%	4,51%				
BRADESCO FI RF IMA B	31.349.992,98	5,13%		1.023.242.068,86	3,06%	OK	OK	OK	2,17%	5,46%	8,47%	8,94%	3,98%					
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	16.996.819,79	2,78%		223.981.721,32	7,59%	OK	OK	OK	1,52%	6,76%	10,57%	16,09%	16,09%	4,54%				
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.593.946,08	0,42%		2.278.219.411,08	0,11%	OK	OK	OK	2,14%	5,08%	8,20%	8,82%	3,82%					
Fundos de Renda Fixa (Normal)	30.731.796,82	5,03%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A												
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.048.596,24	1,81%		6.543.439.694,39	0,17%	OK	OK	OK	0,99%	3,24%	6,67%	13,65%	2,05%					
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.968.662,85	1,30%		128.319.980,47	6,21%	OK	OK	OK	0,86%	3,75%	6,46%	12,04%	2,44%					
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	11.714.537,73	1,92%		6.575.704.719,54	0,18%	OK	OK	OK	0,92%	3,03%	6,24%	12,78%	1,92%					
FIDC	5.435.662,93	0,89%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI												
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	5.435.662,93	0,89%		287.899.727,31	1,89%	OK	OK	OK	1,15%	3,75%	7,70%	15,77%	2,38%					
FIDC Fechado	366.005,87	0,06%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A												
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	229.796,73	0,04%		5.361.933,12	4,29%	OK	OK	OK	8,94%	5,48%	1,35%	-9,58%	7,86%					
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	136.209,14	0,02%		2.737.845,23	4,98%	OK	OK	OK	-1,75%	0,00%	-16,02%	-17,11%	-5,37%					
Fundo Crédito Privado	17.544.157,50	2,87%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B												
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.351.525,00	1,53%		103.380.161,35	9,05%	OK	OK	OK	1,48%	4,41%	7,59%	16,39%	2,89%					
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.192.632,50	1,34%		95.135.697,82	8,61%	OK	OK	OK	1,53%	4,47%	7,78%	16,42%	2,92%					
Fundos de Ações Referenciados	33.584.569,00	5,49%	15,00%			Art. 8o, Inciso I												
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.282.837,18	1,03%		32.367.181,07	19,41%	OK	OK	OK	5,12%	-4,22%	-7,99%	-15,40%	-2,45%					
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.493.394,60	0,90%		463.694.123,55	1,18%	OK	OK	OK	2,15%	-7,12%	-2,86%	-0,05%	-6,05%					
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	21.808.337,22	3,57%		427.720.493,39	5,10%	OK	OK	OK	4,15%	-1,66%	-3,50%	-9,42%	0,49%					
Fundos de Índices de Ações	3.865.042,45	0,63%	2,00%			Art. 8o, Inciso II												
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	3.865.042,45	0,63%		16.723.083,89	23,11%	OK	OK	OK	5,66%	-5,38%	-9,27%	-16,88%	-1,40%					
Fundos de Ações	31.338.454,70	5,13%	15,00%			Art. 8o, Inciso III												
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	10.777.483,10	1,76%		100.758.747,12	10,70%	OK	OK	OK	6,73%	-4,17%	-3,87%	-8,71%	-1,33%					
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.072.386,05	0,83%		307.864.801,65	1,65%	OK	OK	OK	3,07%	0,09%	5,50%	-2,96%	-0,03%					
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.214.847,58	0,53%		101.299.390,74	3,17%	OK	OK	OK	5,03%	-5,80%	-12,03%	-25,95%	-3,57%					
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.179.074,26	0,36%		105.980.977,86	2,06%	OK	OK	OK	1,87%	-5,18%	-6,38%	-12,77%	-1,44%					
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.094.663,71	1,65%		88.221.523,81	11,44%	OK	OK	OK	0,82%	-3,74%	2,38%	1,44%	0,39%					
Fundos Multimercados	4.694.372,78	0,77%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV												
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.688.987,89	0,44%		192.367.382,84	1,40%	OK	OK	OK	0,13%	2,34%	5,25%	14,43%	0,94%					
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.005.384,89	0,33%		151.820.707,32	1,32%	OK	OK	OK	1,33%	-4,45%	4,13%	3,70%	-4,74%					
Fundos de Participações	6.883.560,25	1,13%	5,00%			Art. 8o, Inciso V												
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	369.835,77	0,06%		167.053.212,92	0,22%	OK	OK	OK	-0,41%	-1,28%	-2,50%	1,73%	-0,82%					
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.434.435,21	0,23%		362.242.714,40	0,40%	OK	OK	OK	-0,16%	1,49	0,89	63,27%	-0,38%					
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.079.289,27	0,83%		36.062.953,73	14,08%	OK	OK	OK	-24,09%	(0,15)	(0,13)	-15,15%	-14,83%					
Fundos de Investimento Imobiliários	11.336.962,90	1,85%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI												
DOMO FII	5.800.000,00	0,95%		171.120.094,59	3,39%	OK	OK	OK	8,41%	20,83%	-1,69%	-12,12%	-0,85%					
FI RB CAPITAL RENDA II	5.536.962,90	0,91%		126.041.007,72	4,39%	OK	OK	OK	4,72%	-16,77%	-19,83%	-22,04%	-10,39%					
Disponibilidades Financeiras	20.476,19	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.