

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

29/01/2016

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	594.142.940,55	100,00%	211,00%							1,45%	3,76%	3,89%	10,52%	1,45%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										2,00%	5,08%	8,26%	17,99%	2,00%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,76%	4,79%	8,02%	17,35%	1,76%
Títulos Públicos	108.813.192,19	18,31%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA SBCPREV	108.813.192,19	18,31%								2,04%	4,62%	5,06%	12,38%	2,04%
Fundos que contenham somente títulos públicos	187.432.524,88	31,55%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	111.614.262,81	18,79%		4.198.883.334,36	2,66%	OK	OK	OK	2,91%	5,59%	8,36%	15,89%	2,91%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	24.307.590,05	4,09%		1.746.737.329,73	1,39%	OK	OK	OK	2,93%	5,62%	8,47%	15,98%	2,93%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	51.510.672,02	8,67%		1.232.640.430,95	4,18%	OK	OK	OK	2,96%	5,67%	8,62%	16,29%	2,96%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	157.496.183,27	26,51%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	36.067.407,80	6,07%		855.918.960,52	4,21%	OK	OK	OK	1,88%	4,45%	3,05%	7,34%	1,88%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	71.464.034,70	12,03%		1.202.461.273,48	5,94%	OK	OK	OK	2,95%	5,63%	8,43%	15,94%	2,95%	
BRADESCO FI RF IMA B	30.682.897,24	5,16%		1.020.535.005,25	3,01%	OK	OK	OK	1,76%	4,29%	2,73%	7,25%	1,76%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	16.742.262,85	2,82%		171.636.691,42	9,75%	OK	OK	OK	2,97%	5,72%	8,09%	15,60%	2,97%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.539.580,68	0,43%		2.284.418.068,01	0,11%	OK	OK	OK	1,65%	4,15%	2,80%	7,16%	1,65%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	26.724.943,76	4,50%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.939.934,57	1,84%		6.500.223.272,15	0,17%	OK	OK	OK	1,05%	3,30%	6,79%	13,48%	1,05%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.901.086,71	1,33%		129.096.125,84	6,12%	OK	OK	OK	1,57%	3,87%	6,05%	11,91%	1,57%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	7.883.922,48	1,33%		6.084.472.792,57	0,13%	OK	OK	OK	0,99%	3,12%	6,38%	12,62%	0,99%	
FIDC	5.373.729,27	0,90%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.373.729,27	0,90%		283.908.953,23	1,89%	OK	OK	OK	1,21%	3,81%	7,83%	15,53%	1,21%	
FIDC Fechado	349.674,36	0,06%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	210.938,23	0,04%		4.921.900,57	4,29%	OK	OK	OK	-0,99%	-3,31%	-10,14%	-16,87%	-0,99%	
FIDC TRENDBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	138.736,13	0,02%		2.788.638,50	4,98%	OK	OK	OK	-3,62%	-12,52%	-16,02%	-13,73%	-3,62%	
Fundo Crédito Privado	17.284.309,50	2,91%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.214.950,00	1,55%		101.870.373,74	9,05%	OK	OK	OK	1,39%	4,14%	7,10%	16,35%	1,39%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.069.359,50	1,36%		93.704.246,72	8,61%	OK	OK	OK	1,37%	4,16%	7,16%	16,31%	1,37%	
Fundos de Ações Referenciados	32.294.226,97	5,44%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	5.976.921,38	1,01%		34.007.993,13	17,58%	OK	OK	OK	-7,20%	-11,01%	-19,17%	-11,72%	-7,20%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.377.890,75	0,91%		458.206.513,76	1,17%	OK	OK	OK	-8,02%	-6,54%	-11,15%	2,75%	-8,02%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	20.939.414,84	3,52%		411.497.965,03	5,09%	OK	OK	OK	-3,51%	-6,50%	-13,52%	-6,39%	-3,51%	
Fundos de Índices de Ações	3.658.044,87	0,62%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	3.658.044,87	0,62%		16.201.249,80	22,58%	OK	OK	OK	-6,68%	-11,27%	-20,24%	-13,60%	-6,68%	
Fundos de Ações	30.231.189,82	5,09%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	10.097.642,10	1,70%		101.629.088,26	9,94%	OK	OK	OK	-7,56%	-9,13%	-14,97%	-7,53%	-7,56%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.921.196,68	0,83%		298.688.442,25	1,65%	OK	OK	OK	-3,01%	-0,92%	-5,15%	-0,41%	-3,01%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.060.753,77	0,52%		98.179.656,11	3,12%	OK	OK	OK	-8,19%	-15,85%	-24,58%	-22,70%	-8,19%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.139.133,08	0,36%		108.383.401,69	1,97%	OK	OK	OK	-3,25%	-7,86%	-13,95%	-7,11%	-3,25%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.012.464,19	1,69%		88.678.021,83	11,29%	OK	OK	OK	-0,42%	-3,54%	-1,60%	3,83%	-0,42%	
Fundos Multimercados	4.664.450,91	0,79%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.685.462,33	0,45%		196.375.296,53	1,37%	OK	OK	OK	0,81%	3,75%	5,73%	15,96%	0,81%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	1.978.988,58	0,33%		166.147.428,03	1,19%	OK	OK	OK	-6,00%	-4,42%	-2,58%	8,24%	-6,00%	
Fundos de Participações	8.499.313,53	1,43%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	371.343,01	0,06%		167.734.023,92	0,22%	OK	OK	OK	-0,42%	-1,28%	5,57%	1,50%	-0,42%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.436.701,36	0,24%		362.814.991,60	0,40%	OK	OK	OK	-0,24%	-	-	62,82%	-0,24%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.691.269,16	1,13%		47.508.011,10	14,08%	OK	OK	OK	12,47%	-	-	11,63%	12,47%	
Fundos de Investimento Imobiliários	10.637.637,67	1,79%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.350.000,00	0,90%		170.937.876,70	3,13%	OK	OK	OK	-8,55%	8,74%	-13,01%	-15,21%	-8,55%	
FI RB CAPITAL RENDA II	5.287.637,67	0,89%		125.822.214,09	4,20%	OK	OK	OK	-14,43%	-22,48%	-24,16%	-24,96%	-14,43%	
Disponibilidades Financeiras	683.519,55	0,12%												

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.