

## ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

29/07/2016

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>699.173.332,52</b>	<b>100,00%</b>	<b>211,00%</b>							<b>2,72%</b>	<b>3,56%</b>	<b>11,85%</b>	<b>16,20%</b>	<b>13,46%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										1,13%	3,60%	7,27%	16,13%	9,42%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										1,01%	3,15%	6,71%	15,26%	8,59%
<b>Títulos Públicos</b>	<b>122.998.767,22</b>	<b>17,59%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	122.998.767,22	17,59%								1,90%	1,08%	13,30%	19,04%	15,61%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>190.263.143,47</b>	<b>27,21%</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	59.310.532,04	1,52%		59.310.532,04	17,93%	OK	OK	OK	2,57%	4,20%	16,18%	16,18%	19,85%	18,20%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	119.769.265,02	17,13%		5.389.170.257,20	2,22%	OK	OK	OK	1,19%	2,91%	6,84%	15,77%	9,96%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INF LACAO 5 FICFI	5.780.635,62	0,83%		2.150.711.919,93	0,27%	OK	OK	OK	1,17%	2,87%	6,75%	15,79%	9,88%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	54.076.044,44	7,73%		1.573.294.917,70	3,44%	OK	OK	OK	1,17%	2,90%	6,85%	16,06%	10,01%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA</b>	<b>198.388.241,10</b>	<b>28,37%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
SAFRA IMA FIC FI RF	5.091.844,00	0,73%		207.625.041,06	2,45%	OK	OK	OK	2,48%	4,17%	15,20%	20,33%	17,19%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	74.431.188,09	10,65%		1.883.872.588,62	3,95%	OK	OK	OK	1,18%	2,90%	6,87%	15,88%	10,02%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	41.963.683,94	6,00%		979.215.484,53	4,29%	OK	OK	OK	2,46%	4,20%	16,35%	19,89%	18,53%	
BRADESCO FI RF IMA B	38.861.427,56	5,56%		1.048.846.055,63	3,71%	OK	OK	OK	2,48%	4,31%	16,56%	19,74%	18,61%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	17.894.154,95	2,56%		227.641.654,14	7,86%	OK	OK	OK	1,16%	2,81%	6,88%	15,53%	10,06%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	20.145.942,56	2,88%		2.355.481.144,47	0,86%	OK	OK	OK	2,39%	4,36%	16,28%	19,54%	18,20%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>48.740.898,87</b>	<b>6,97%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.684.392,78	1,67%		6.069.540.839,85	0,19%	OK	OK	OK	1,13%	3,47%	6,80%	14,06%	7,93%	
ITAU INSTIT ALOCAAO DINAMICA RF FICFI	23.862.017,31	3,41%		754.288.682,39	3,16%	OK	OK	OK	1,68%	3,84%	13,31%	19,27%	14,90%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	8.477.803,32	1,21%		189.196.441,91	4,48%	OK	OK	OK	1,26%	3,25%	7,30%	13,80%	8,99%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	4.716.685,46	0,67%		8.377.097.003,92	0,06%	OK	OK	OK	1,05%	3,24%	6,36%	13,15%	7,41%	
<b>FIDC</b>	<b>5.794.557,91</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	5.794.557,91	0,83%		311.321.060,72	1,86%	OK	OK	OK	1,27%	3,94%	7,83%	16,28%	9,14%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>151.415,29</b>	<b>0,02%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	37.716,43	0,01%		880.051,67	4,29%	OK	OK	OK	-5,49%	-	-	-83,93%	-67,66%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	113.698,86	0,02%		2.285.381,73	4,98%	OK	OK	OK	-5,74%	-	-18,05%	-31,17%	-21,21%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>18.524.891,00</b>	<b>2,65%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso VII, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.880.085,00	1,41%		109.223.379,58	9,05%	OK	OK	OK	0,93%	3,29%	7,22%	14,83%	8,70%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.644.806,00	1,24%		100.386.505,71	8,61%	OK	OK	OK	0,88%	3,25%	7,13%	14,80%	8,60%	
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>41.677.420,30</b>	<b>5,96%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	8.126.240,98	1,16%		34.668.997,30	23,44%	OK	OK	OK	9,92%	6,25%	35,96%	9,89%	26,17%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.674.689,00	0,81%		477.662.788,62	1,19%	OK	OK	OK	10,61%	6,32%	5,52%	-6,25%	-2,95%	
ITAU RPI ACOES IBOVESA ATIVO FICFI	27.876.490,32	3,99%		468.496.918,04	5,95%	OK	OK	OK	9,92%	10,19%	33,13%	15,13%	28,45%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>5.161.177,98</b>	<b>0,74%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESA	5.161.177,98	0,74%		24.907.720,70	20,72%	OK	OK	OK	11,14%	6,40%	41,09%	12,53%	31,66%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>41.647.510,44</b>	<b>5,96%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	13.707.159,47	1,96%		119.337.989,90	11,49%	OK	OK	OK	13,27%	7,15%	35,75%	15,43%	25,49%	
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	12.202.632,69	1,75%		121.413.217,90	10,05%	OK	OK	OK	10,21%	14,01%	21,87%	19,93%	21,36%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.678.540,98	0,81%		344.654.790,06	1,65%	OK	OK	OK	5,12%	4,18%	15,39%	9,45%	11,92%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.028.782,72	0,43%		258.166.548,57	1,17%	OK	OK	OK	9,00%	4,18%	1,29%	-10,38%	-4,60%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.337.415,71	0,62%		123.094.440,84	3,52%	OK	OK	OK	12,60%	9,22%	41,71%	6,87%	30,10%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.692.978,87	0,39%		131.790.602,09	2,04%	OK	OK	OK	13,81%	8,83%	25,89%	8,33%	21,80%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>5.137.327,26</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	2.765.656,19	0,40%		154.732.953,37	1,79%	OK	OK	OK	1,17%	3,73%	2,99%	8,89%	3,82%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.371.671,07	0,34%		136.823.630,45	1,73%	OK	OK	OK	4,64%	8,73%	19,84%	16,76%	12,65%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>8.575.859,20</b>	<b>1,23%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	536.832,55	0,08%		241.939.301,96	0,22%	OK	OK	OK	-0,15%	-0,38%	3,91%	9,69%	3,47%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	909.494,17	0,13%		229.677.599,90	0,40%	OK	OK	OK	-25,57%	-33,76%	-36,70%	24,08%	-36,20%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	7.129.532,48	1,02%		50.619.680,64	14,08%	OK	OK	OK	0,29%	-1,32%	-20,08%	-9,18%	-10,33%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>12.091.495,18</b>	<b>1,73%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	5.350.000,00	0,77%		173.542.101,36	3,08%	OK	OK	OK	2,89%	-7,76%	0,00%	-13,01%	-8,55%	
FII RB CAPITAL RENDA II	6.741.495,18	0,96%		127.679.840,94	5,28%	OK	OK	OK	4,73%	5,87%	23,41%	-6,41%	5,60%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>20.627,30</b>	<b>0,003%</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.