

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

30/06/2016

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	675.201.540,23	100,00%	211,00%						1,54%	3,50%	10,45%	13,77%	10,45%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,96%	3,60%	8,20%	16,06%	8,20%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,84%	3,24%	7,50%	15,38%	7,50%
Títulos Públicos	120.724.949,02	17,88%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	120.724.949,02	17,88%							1,78%	2,76%	13,46%	17,11%	13,46%
Fundos que contenham somente títulos públicos	207.284.198,16	30,70%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	10.370.724,75	1,54%		55.788.819,62	18,59%	OK	OK	OK	1,68%	5,62%	15,24%	16,53%	15,24%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	117.816.754,64	17,45%		5.287.698.861,53	2,23%	OK	OK	OK	0,92%	3,26%	8,66%	16,43%	8,66%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	25.648.063,53	3,80%		2.113.723.699,40	1,21%	OK	OK	OK	0,90%	3,21%	8,61%	16,44%	8,61%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	53.448.655,24	7,92%		1.535.560.353,00	3,48%	OK	OK	OK	0,92%	3,26%	8,73%	16,74%	8,73%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	194.254.187,39	28,77%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	78.013.379,82	11,55%		1.758.048.467,38	4,44%	OK	OK	OK	0,91%	3,28%	8,75%	16,54%	8,75%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	40.955.262,48	6,07%		965.702.846,13	4,24%	OK	OK	OK	1,84%	5,64%	15,68%	16,13%	15,68%
BRADESCO FI RF IMA B	37.921.178,68	5,62%		1.009.545.222,24	3,76%	OK	OK	OK	1,94%	5,94%	15,75%	15,97%	15,75%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	17.688.485,17	2,62%		212.550.351,25	8,32%	OK	OK	OK	0,88%	3,32%	8,79%	16,23%	8,79%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	19.675.881,24	2,91%		2.216.566.245,83	0,89%	OK	OK	OK	1,90%	5,66%	15,44%	15,52%	15,44%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	23.106.890,59	3,42%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.553.331,72	1,71%		6.049.752.820,82	0,19%	OK	OK	OK	1,18%	3,38%	6,72%	14,11%	6,72%
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	8.372.404,87	1,24%		185.114.742,85	4,52%	OK	OK	OK	1,22%	3,74%	7,63%	13,23%	7,63%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	3.181.154,00	0,47%		8.093.349.562,81	0,04%	OK	OK	OK	1,11%	3,19%	6,29%	13,23%	6,29%
FIDC	5.721.618,65	0,85%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.721.618,65	0,85%		314.709.514,22	1,82%	OK	OK	OK	1,34%	3,87%	7,77%	16,37%	7,77%
FIDC Fechado	160.607,98	0,02%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	39.907,66	0,01%		931.180,27	4,29%	OK	OK	OK	-68,98%	-82,38%	-81,27%	-83,29%	-81,27%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	120.700,32	0,02%		2.426.113,32	4,98%	OK	OK	OK	-1,91%	-	-16,25%	-27,66%	-16,25%
Fundo Crédito Privado	18.357.962,00	2,72%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.788.945,00	1,45%		108.215.842,44	9,05%	OK	OK	OK	1,22%	3,30%	7,70%	15,13%	7,70%
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.569.017,00	1,27%		99.506.440,11	8,61%	OK	OK	OK	1,19%	3,28%	7,65%	15,06%	7,65%
Fundos de Ações Referenciados	37.883.246,90	5,61%	15,00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	7.393.045,48	1,09%		35.431.034,04	20,87%	OK	OK	OK	4,99%	4,59%	14,78%	-4,25%	14,78%
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.130.269,00	0,76%		433.709.901,34	1,18%	OK	OK	OK	4,61%	-1,39%	-12,26%	-13,09%	-12,26%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	25.359.932,42	3,76%		471.039.649,96	5,38%	OK	OK	OK	5,53%	5,90%	16,86%	2,60%	16,86%
Fundos de Índices de Ações	4.643.937,62	0,69%	2,00%			Art. 8o, Inciso II					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.643.937,62	0,69%		21.042.366,26	22,07%	OK	OK	OK	6,03%	3,07%	18,47%	-2,83%	18,47%
Fundos de Ações	37.572.546,55	5,56%	15,00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	12.101.349,48	1,79%		105.106.570,13	11,51%	OK	OK	OK	6,59%	0,53%	10,78%	-0,48%	10,78%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	11.072.458,79	1,64%		106.264.433,09	10,42%	OK	OK	OK	4,71%	8,13%	10,12%	9,37%	10,12%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.401.952,43	0,80%		327.867.481,80	1,65%	OK	OK	OK	2,50%	2,50%	6,47%	2,99%	6,47%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.778.586,58	0,41%		237.928.148,63	1,17%	OK	OK	OK	3,91%	-3,08%	-12,48%	-15,14%	-12,48%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.851.974,29	0,57%		111.413.654,20	3,46%	OK	OK	OK	7,21%	5,05%	15,54%	-5,72%	15,54%
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.366.224,98	0,35%		121.347.018,48	1,95%	OK	OK	OK	3,88%	-0,14%	7,02%	-5,26%	7,02%
Fundos Multimercados	5.000.022,82	0,74%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.733.590,11	0,40%		156.217.900,60	1,75%	OK	OK	OK	1,49%	3,05%	2,62%	10,16%	2,62%
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.266.432,71	0,34%		134.237.995,15	1,69%	OK	OK	OK	1,08%	5,18%	7,65%	14,81%	7,65%
Fundos de Participações	8.766.842,99	1,30%	5,00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	537.626,88	0,08%		242.297.286,77	0,22%	OK	OK	OK	-0,08%	4,41%	3,62%	9,05%	3,62%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.221.941,28	0,18%		308.580.912,00	0,40%	OK	OK	OK	-10,81%	-	-15,15%	71,35%	-15,15%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	7.007.274,83	1,04%		49.751.651,42	14,08%	OK	OK	OK	-6,60%	-1,49%	-10,59%	-9,58%	-10,59%
Fundos de Investimento Imobiliários	11.669.004,02	1,73%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.199.500,00	0,77%		172.395.932,04	3,02%	OK	OK	OK	-11,87%	-10,20%	-11,12%	-17,47%	-11,12%
FII RB CAPITAL RENDA II	6.469.504,02	0,96%		127.331.488,08	5,08%	OK	OK	OK	-0,66%	2,74%	0,84%	-10,30%	0,84%
Disponibilidades Financeiras	55.525,54	0,01%											

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.