

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

31/05/2016

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	659.673.421,67	100,00%	211,00%							-0,72%	5,23%	10,68%	12,70%	8,77%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,47%	3,57%	8,66%	16,41%	7,17%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,27%	3,33%	8,16%	15,88%	6,61%
Títulos Públicos	118.630.377,43	17,98%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	118.630.377,43	17,98%								-2,54%	6,56%	13,26%	15,08%	11,48%
Fundos que contenham somente títulos públicos	202.174.273,58	30,65%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	10.199.336,62	1,55%		56.250.953,32	18,13%	OK	OK	OK	-0,09%	8,86%	14,90%	14,38%	13,34%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	113.595.441,79	17,22%		5.154.104.401,04	2,20%	OK	OK	OK	0,78%	3,07%	9,87%	16,25%	7,67%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	25.418.658,75	3,85%		2.067.128.113,06	1,23%	OK	OK	OK	0,76%	3,02%	9,88%	16,33%	7,64%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	52.960.836,42	8,03%		1.448.240.247,55	3,66%	OK	OK	OK	0,78%	3,08%	10,00%	16,63%	7,74%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	191.049.732,80	28,96%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	40.216.790,85	6,10%		942.098.546,61	4,27%	OK	OK	OK	-0,14%	9,09%	15,30%	13,70%	13,60%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	76.792.468,79	11,64%		1.669.843.094,94	4,60%	OK	OK	OK	0,79%	3,12%	10,00%	16,41%	7,77%	
BRADESCO FI RF IMA B	37.197.998,60	5,64%		1.087.721.973,29	3,42%	OK	OK	OK	-0,15%	9,19%	15,16%	13,46%	13,54%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	17.534.281,64	2,66%		208.254.570,36	8,42%	OK	OK	OK	0,75%	3,16%	10,14%	16,11%	7,84%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	19.308.192,92	2,93%		2.183.514.885,24	0,88%	OK	OK	OK	0,02%	9,11%	14,65%	13,11%	13,28%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	20.829.605,84	3,16%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.418.651,40	1,73%		6.538.328.087,85	0,17%	OK	OK	OK	1,12%	3,35%	6,70%	14,00%	5,47%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	8.271.725,35	1,25%		176.815.682,97	4,68%	OK	OK	OK	0,74%	3,80%	7,70%	13,13%	6,34%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	1.139.229,09	0,17%		7.764.628.479,42	0,01%	OK	OK	OK	1,05%	3,15%	6,28%	13,12%	5,13%	
FIDC	5.646.192,86	0,86%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.646.192,86	0,86%		310.560.825,81	1,82%	OK	OK	OK	1,27%	3,87%	7,77%	16,24%	6,35%	
FIDC Fechado	251.700,34	0,04%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	128.655,57	0,02%		3.001.968,58	4,29%	OK	OK	OK	-47,49%	-44,01%	-40,94%	-48,12%	-39,61%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	123.044,77	0,02%		2.473.237,39	4,98%	OK	OK	OK	-5,91%	-	-	-5,24%	3,41%	
Fundo Crédito Privado	18.138.560,50	2,75%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.670.555,00	1,47%		106.907.023,57	9,05%	OK	OK	OK	1,10%	3,41%	7,97%	15,09%	6,40%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.468.005,50	1,28%		98.333.464,87	8,61%	OK	OK	OK	1,14%	3,36%	7,99%	15,12%	6,38%	
Fundos de Ações Referenciados	35.977.631,44	5,45%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.041.485,00	1,07%		32.855.260,70	21,43%	OK	OK	OK	-7,93%	12,07%	7,34%	-7,72%	9,33%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	4.904.045,35	0,74%		414.133.328,09	1,18%	OK	OK	OK	-8,11%	-10,73%	-17,08%	-15,78%	-16,13%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	24.032.101,09	3,64%		446.376.375,43	5,38%	OK	OK	OK	-5,01%	10,20%	8,36%	-2,15%	10,74%	
Fundos de Índices de Ações	4.379.822,98	0,66%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.379.822,98	0,66%		21.288.964,94	20,57%	OK	OK	OK	-9,71%	13,32%	7,23%	-7,98%	11,73%	
Fundos de Ações	35.742.864,14	5,42%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.674.135,30	0,41%		228.503.504,09	1,17%	OK	OK	OK	-8,02%	-12,60%	-18,39%	-17,29%	-15,77%	
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	11.353.239,06	1,72%		100.451.395,61	11,30%	OK	OK	OK	-11,25%	5,34%	0,95%	-5,19%	3,94%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.270.272,18	0,80%		319.875.143,86	1,65%	OK	OK	OK	-3,31%	3,90%	3,99%	0,11%	3,87%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.592.851,37	0,54%		106.005.410,69	3,39%	OK	OK	OK	-9,53%	11,76%	5,28%	-13,10%	7,77%	
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.277.814,52	0,35%		116.141.235,88	1,96%	OK	OK	OK	-7,95%	4,53%	-0,88%	-9,09%	3,02%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.574.551,71	1,60%		100.457.614,76	10,53%	OK	OK	OK	-1,20%	4,75%	0,83%	3,32%	5,17%	
Fundos Multimercados	4.935.684,71	0,75%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.693.545,29	0,41%		169.629.210,29	1,59%	OK	OK	OK	1,03%	0,17%	2,51%	9,74%	1,11%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.242.139,42	0,34%		138.467.242,97	1,62%	OK	OK	OK	2,79%	11,81%	6,83%	12,47%	6,50%	
Fundos de Participações	9.410.754,65	1,43%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	538.081,46	0,08%		242.502.167,83	0,22%	OK	OK	OK	-0,15%	4,57%	3,24%	8,43%	3,71%	
BTG ACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.369.982,21	0,21%		345.966.178,70	0,40%	OK	OK	OK	-0,22%	-4,49%	137,75%	84,76%	-4,85%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	7.502.690,98	1,14%		53.269.105,86	14,08%	OK	OK	OK	5,35%	12,40%	-4,07%	-3,65%	-4,26%	
Fundos de Investimento Imobiliários	12.468.802,38	1,89%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.900.000,00	0,89%		170.769.765,26	3,45%	OK	OK	OK	1,72%	1,72%	22,92%	-6,35%	0,85%	
FII RB CAPITAL RENDA II	6.568.802,38	1,00%		126.921.299,56	5,18%	OK	OK	OK	2,35%	17,93%	-5,72%	-9,15%	1,51%	
Disponibilidades Financeiras	37.418,02	0,006%												

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.