

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

31/03/2016

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	634.911.280,06	100,00%	211,00%						3,24%	6,72%	11,40%	13,45%	6,72%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,93%	4,44%	8,94%	16,50%	4,44%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,92%	4,13%	8,63%	15,95%	4,13%
Títulos Públicos	117.529.477,73	18,51%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	117.529.477,73	18,51%							5,54%	10,41%	16,20%	18,47%	10,41%
Fundos que contenham somente títulos públicos	202.529.549,54	31,90%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	5.104.696,09	0,80%		46.988.640,73	10,86%	OK	OK	OK	4,80%	9,11%	14,95%	15,77%	9,11%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	119.890.010,51	18,88%		4.727.983.554,74	2,54%	OK	OK	OK	0,73%	5,24%	10,60%	16,05%	5,24%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	24.851.352,26	3,91%		1.961.009.424,33	1,27%	OK	OK	OK	0,72%	5,24%	10,62%	16,05%	5,24%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	52.683.490,68	8,30%		1.334.639.183,52	3,95%	OK	OK	OK	0,74%	5,30%	10,74%	16,35%	5,30%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKA	165.550.845,40	26,07%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	38.767.022,72	6,11%		906.306.624,70	4,28%	OK	OK	OK	5,16%	9,50%	15,02%	15,22%	9,50%
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	73.991.419,19	11,65%		1.609.080.196,25	4,60%	OK	OK	OK	0,75%	5,29%	10,66%	16,12%	5,29%
BRADESCO FI RF IMA B	32.942.737,43	5,19%		1.025.977.549,72	3,21%	OK	OK	OK	5,08%	9,26%	14,78%	14,89%	9,26%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	17.120.000,05	2,70%		223.310.227,62	7,67%	OK	OK	OK	0,72%	5,30%	10,74%	15,86%	5,30%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	2.729.666,01	0,43%		2.180.053.523,18	0,13%	OK	OK	OK	5,23%	9,26%	14,76%	14,44%	9,26%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	24.380.928,14	3,84%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.175.392,79	1,76%		6.402.341.873,63	0,17%	OK	OK	OK	1,15%	3,23%	6,69%	13,76%	3,23%
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	8.070.395,44	1,27%		136.677.951,76	5,90%	OK	OK	OK	1,28%	3,75%	7,14%	12,64%	3,75%
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	5.135.139,91	0,81%		7.101.944.835,62	0,07%	OK	OK	OK	1,07%	3,01%	6,27%	12,87%	3,01%
FIDC	5.508.269,83	0,87%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.508.269,83	0,87%		303.439.144,76	1,82%	OK	OK	OK	1,34%	3,75%	7,77%	15,93%	3,75%
FIDC Fechado	360.322,29	0,06%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	226.488,96	0,04%		5.284.751,67	4,29%	OK	OK	OK	-1,44%	6,31%	1,11%	-8,57%	6,31%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	133.833,33	0,02%		2.690.090,80	4,98%	OK	OK	OK	-1,74%	-7,09%	-17,47%	-17,81%	-7,09%
Fundo Crédito Privado	17.773.743,00	2,80%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.476.535,00	1,49%		104.762.152,67	9,05%	OK	OK	OK	1,34%	4,26%	8,22%	15,84%	4,26%
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.297.208,00	1,31%		96.350.101,56	8,61%	OK	OK	OK	1,28%	4,23%	8,32%	15,75%	4,23%
Fundos de Ações Referenciados	36.219.235,24	5,70%	15,00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.068.617,86	1,11%		36.292.129,14	19,48%	OK	OK	OK	12,51%	9,75%	6,54%	-4,39%	9,75%
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.202.582,90	0,82%		442.237.448,45	1,18%	OK	OK	OK	-5,29%	-11,02%	-10,13%	-8,42%	-11,02%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	23.948.034,48	3,77%		451.203.118,83	5,31%	OK	OK	OK	9,81%	10,35%	7,77%	-1,59%	10,35%
Fundos de Índices de Ações	4.505.734,95	0,71%	2,00%			Art. 8o, Inciso II					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.505.734,95	0,71%		19.998.510,63	22,53%	OK	OK	OK	16,58%	14,94%	10,66%	-2,65%	14,94%
Fundos de Ações	36.450.662,85	5,74%	15,00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.866.931,59	0,45%		247.506.436,08	1,16%	OK	OK	OK	-6,29%	-9,70%	-10,45%	-8,87%	-9,70%
BNY MELLON ARX INCOME FI DE ACOES	12.037.652,68	1,90%		111.519.697,78	10,79%	OK	OK	OK	11,69%	10,20%	6,43%	0,62%	10,20%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.270.272,18	0,83%		319.875.281,83	1,65%	OK	OK	OK	3,90%	3,87%	10,60%	1,68%	3,87%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.666.831,76	0,58%		110.919.824,29	3,31%	OK	OK	OK	14,06%	9,99%	6,05%	-11,12%	9,99%
QUEST ACOES FIC FI ACOES	2.369.461,54	0,37%		113.702.842,15	2,08%	OK	OK	OK	8,74%	7,17%	2,51%	-6,94%	7,17%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.239.513,10	1,61%		87.032.302,52	11,77%	OK	OK	OK	1,43%	1,83%	2,45%	-0,71%	1,83%
Fundos Multimercados	4.807.586,36	0,76%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.652.801,91	0,42%		183.332.402,36	1,45%	OK	OK	OK	-1,35%	-0,42%	1,89%	9,74%	-0,42%
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.154.784,45	0,34%		146.210.783,10	1,47%	OK	OK	OK	7,45%	2,35%	13,85%	12,23%	2,35%
Fundos de Participações	7.170.490,21	1,13%	5,00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	381.971,64	0,06%		172.558.864,79	0,22%	OK	OK	OK	0,08%	-0,75%	-2,02%	2,48%	-0,75%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.375.439,28	0,22%		347.344.272,60	0,40%	OK	OK	OK	-4,11%	-4,47%	82,31%	57,31%	-4,47%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.413.079,29	0,85%		38.432.862,85	14,08%	OK	OK	OK	6,57%	-9,23%	-7,55%	-9,14%	-9,23%
Fundos de Investimento Imobiliários	12.104.080,50	1,91%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.790.000,00	0,91%		171.183.406,46	3,38%	OK	OK	OK	-0,17%	-1,03%	11,35%	-5,08%	-1,03%
FII RB CAPITAL RENDA II	6.314.080,50	0,99%		126.572.215,97	4,99%	OK	OK	OK	14,04%	-1,85%	-8,44%	-12,03%	-1,85%
Disponibilidades Financeiras	20.354,02	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.