

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

30/11/2016

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	
RF	620.051.414,16	83,34%	164,00%							-0,22%	1,92%	6,04%	17,91%	15,83%
RV	123.976.263,03	16,66%	47,00%							-6,26%	3,31%	16,19%	24,73%	22,83%
CONSOLIDADO	744.042.590,49	100,00%	211,00%							-1,22%	2,33%	7,84%	19,36%	17,31%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,56%	1,79%	4,76%	13,83%	12,27%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,67%	2,00%	4,85%	13,41%	11,78%
Títulos Públicos	122.512.662,22	16,47%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	122.512.662,22	16,47%								-0,83%	1,16%	6,23%	20,31%	18,42%
Fundos que contenham somente títulos públicos	232.359.996,46	31,23%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	11.835.575,30	1,59%		64.803.699,90	18,26%	OK	OK	OK		-1,28%	1,31%	6,37%	22,22%	20,56%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	3.456.928,25	0,46%		1.347.018.598,38	0,26%	OK	OK	OK		0,27%	3,54%	8,09%	21,70%	21,07%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	146.896.435,04	19,74%		5.723.242.514,74	2,57%	OK	OK	OK		0,38%	2,25%	5,53%	15,95%	13,63%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	5.969.627,69	0,80%		2.052.041.937,49	0,29%	OK	OK	OK		0,37%	2,18%	5,42%	15,84%	13,48%
SAFRA IMA FIC FI RF	8.313.280,38	1,12%		318.867.440,51	2,61%	OK	OK	OK		-1,26%	0,91%	6,10%	21,09%	19,20%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	55.888.149,80	7,51%		1.584.955.687,69	3,53%	OK	OK	OK		0,39%	2,23%	5,53%	16,08%	13,69%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	202.262.206,26	27,18%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	67.449.158,05	9,07%		2.054.584.718,81	3,28%	OK	OK	OK		0,38%	2,23%	5,54%	16,09%	13,73%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	43.606.443,47	5,86%		1.117.652.616,05	3,90%	OK	OK	OK		-1,21%	1,06%	6,49%	22,78%	20,97%
BRANDESCO INST FIC FI RF IMA B	39.646.056,08	5,33%		1.246.063.372,24	3,18%	OK	OK	OK		-1,27%	1,09%	6,58%	22,74%	21,01%
BRANDESCO INST FIC FI RF IMA B 5	23.511.881,75	3,16%		280.516.200,35	8,38%	OK	OK	OK		0,32%	2,23%	5,44%	16,12%	13,71%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	28.048.666,91	3,77%		2.318.860.060,89	1,21%	OK	OK	OK		-1,15%	1,18%	6,59%	22,21%	20,75%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	56.663.720,25	7,62%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	11.703.682,97	1,57%		212.996.505,97	5,49%	OK	OK	OK		-0,19%	1,66%	5,52%	13,65%	12,21%
BRANDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.232.624,29	1,64%		6.740.519.275,14	0,18%	OK	OK	OK		1,12%	3,43%	7,13%	14,31%	12,99%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	29.701.624,80	3,99%		1.204.251.368,16	2,47%	OK	OK	OK		-0,23%	2,59%	7,38%	20,12%	18,96%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	3.025.788,19	0,41%		8.712.734.548,18	0,03%	OK	OK	OK		0,99%	3,06%	6,50%	13,18%	11,96%
FIDC	6.094.110,66	0,82%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	6.094.110,66	0,82%		331.616.221,85	1,84%	OK	OK	OK		1,19%	3,72%	7,93%	16,32%	14,78%
FIDC Fechado	158.718,31	0,02%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	37.661,40	0,01%		878.767,49	4,29%	OK	OK	OK		-22,82%	371,22%	518,30%	1142,74%	1131,01%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	121.056,91	0,02%		2.433.280,88	4,98%	OK	OK	OK		-2,54%	20,76%	-1,62%	-18,82%	-15,96%
Fundo Crédito Privado			5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	45.441.429,74	6,11%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	8.856.679,65	1,19%		37.728.312,56	23,47%	OK	OK	OK		-4,45%	6,33%	25,78%	35,02%	37,51%
GERACAO FIA PROGRAMADO	8.042.624,15	1,08%		517.941.687,49	1,55%	OK	OK	OK		-6,79%	5,81%	23,44%	2,35%	3,54%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	28.542.125,94	3,84%		488.574.057,83	5,84%	OK	OK	OK		-6,07%	2,45%	18,77%	28,70%	31,52%
Fundos de Índices de Ações	5.572.958,45	0,75%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.572.958,45	0,75%		25.126.586,01	22,18%	OK	OK	OK		-4,36%	7,13%	27,24%	36,44%	42,17%
Fundos de Ações	47.571.495,64	6,39%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.182.844,83	2,31%		129.879.540,84	13,23%	OK	OK	OK		-5,80%	6,22%	33,40%	34,67%	38,65%
AZ QUEST ACOES FC FIA	4.797.084,96	0,64%		127.088.441,06	3,77%	OK	OK	OK		-7,14%	3,57%	24,49%	23,39%	28,25%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	11.807.401,47	1,59%		137.878.418,19	8,56%	OK	OK	OK		-8,59%	-1,32%	11,66%	12,59%	17,43%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.731.993,04	0,77%		347.898.932,29	1,65%	OK	OK	OK		-6,08%	0,07%	8,76%	13,10%	12,97%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.055.210,71	0,41%		260.265.006,66	1,17%	OK	OK	OK		-10,97%	-0,74%	14,25%	-6,76%	-3,77%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.996.960,63	0,67%		135.495.675,31	3,69%	OK	OK	OK		-2,36%	13,67%	39,08%	46,42%	49,89%
Fundos Multimercados	5.396.595,43	0,73%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.890.930,37	0,39%		137.518.113,11	2,10%	OK	OK	OK		0,45%	3,62%	7,33%	10,02%	8,52%
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.505.665,06	0,34%		134.389.379,80	1,86%	OK	OK	OK		4,50%	4,48%	11,75%	19,39%	19,02%
Fundos de Participações	7.724.004,77	1,04%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	503.729,97	0,07%		227.020.656,87	0,22%	OK	OK	OK		-0,09%	-0,28%	-6,38%	-3,35%	-2,91%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	834.044,19	0,11%		211.381.563,10	0,39%	OK	OK	OK		-0,53%	-1,61%	-13,50%	105,62%	-17,71%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.386.230,61	0,86%		45.342.237,32	14,08%	OK	OK	OK		-15,04%	-11,13%	-16,64%	-20,03%	-20,19%
Fundos de Investimento Imobiliários	12.269.779,00	1,65%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.470.000,00	0,74%		178.874.554,55	3,06%	OK	OK	OK		-11,77%	4,79%	-7,29%	13,96%	-6,50%
FII RB CAPITAL RENDA II	6.799.779,00	0,91%		124.942.769,73	5,44%	OK	OK	OK		-2,96%	-2,40%	-1,56%	0,75%	-0,34%
Disponibilidades Financeiras	14.913,30	0,002%												

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.