

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

30/09/2016

| 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 | 611.344.089,98 | 84,04% | 164,00% | | | | | | 1,57% | 4,32% | 8,03% | 21,17% | 15,43% |
| RV | 116.066.925,75 | 15,96% | 47,00% | | | | | | 0,90% | 10,31% | 13,73% | 22,24% | 19,96% |
| CONSOLIDADO | 727.428.029,27 | 100,00% | 211,00% | | | | | | 1,46% | 5,31% | 8,99% | 21,44% | 16,32% |
| META ATUARIAL (INPC + 6%) | | | | | | | | | 0,57% | 2,52% | 6,21% | 15,70% | 10,92% |
| META ATUARIAL (IPCA + 6%) | | | | | | | | | 0,57% | 2,53% | 5,85% | 14,98% | 10,22% |
| Títulos Públicos | 126.469.131,57 | 17,39% | 40,00% | | | Art. 7o, Inciso I, Alínea A | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| CARTEIRA PROPRIA SBCPREV | 126.469.131,57 | 17,39% | | | | | | | 1,55% | 4,77% | 7,67% | 21,45% | 18,88% |
| Fundos que contenham somente títulos públicos | 222.896.601,75 | 30,64% | 50,00% | | | Art. 7o, Inciso I, Alínea B | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP | 10.896.272,13 | 1,50% | | 65.283.775,02 | 16,69% | OK | OK | OK | 1,75% | 5,07% | 10,97% | 27,56% | 21,08% |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP | 145.438.129,59 | 19,99% | | 6.082.965.267,18 | 2,39% | OK | OK | OK | 1,40% | 3,70% | 7,08% | 18,43% | 12,68% |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI | 5.922.395,45 | 0,81% | | 2.171.390.486,84 | 0,27% | OK | OK | OK | 1,38% | 3,65% | 6,98% | 18,34% | 12,58% |
| SAFRA IMA FIC FI RF | 5.212.043,31 | 0,72% | | 277.963.130,60 | 1,88% | OK | OK | OK | 1,55% | 4,90% | 10,37% | 25,86% | 19,96% |
| SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF | 55.427.761,27 | 7,62% | | 1.683.893.135,40 | 3,29% | OK | OK | OK | 1,39% | 3,70% | 7,08% | 18,58% | 12,76% |
| Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA | 202.930.055,32 | 27,90% | 35,00% | | | Art. 7o, Inciso III, Alínea A | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC | 77.357.142,13 | 10,63% | | 2.234.777.780,68 | 3,46% | OK | OK | OK | 1,39% | 3,73% | 7,13% | 18,55% | 12,80% |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI | 43.073.004,58 | 5,92% | | 1.169.761.031,60 | 3,68% | OK | OK | OK | 1,64% | 5,17% | 11,11% | 27,79% | 21,66% |
| BRADERCO INST FIC FI RF IMA B | 39.873.492,78 | 5,48% | | 1.191.572.422,21 | 3,35% | OK | OK | OK | 1,67% | 5,15% | 11,39% | 27,86% | 21,70% |
| BRADERCO INST FIC FI RF IMA B 5 | 18.337.986,06 | 2,52% | | 314.252.368,54 | 5,84% | OK | OK | OK | 1,40% | 3,67% | 7,11% | 18,62% | 12,79% |
| CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP | 24.288.429,77 | 3,34% | | 2.345.947.611,75 | 1,04% | OK | OK | OK | 1,51% | 4,94% | 10,88% | 27,24% | 21,14% |
| Fundos de Renda Fixa (Normal) | 52.785.278,25 | 7,26% | 30,00% | | | Art. 7o, Inciso IV, Alínea A | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO | 8.668.703,47 | 1,19% | | 230.568.636,24 | 3,76% | OK | OK | OK | 0,97% | 3,54% | 7,41% | 15,08% | 11,44% |
| BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM | 11.956.543,31 | 1,64% | | 6.698.513.271,76 | 0,18% | OK | OK | OK | 1,10% | 3,49% | 6,99% | 14,15% | 10,44% |
| ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 24.515.540,74 | 3,37% | | 1.151.542.145,17 | 2,13% | OK | OK | OK | 1,81% | 4,46% | 10,29% | 21,56% | 18,05% |
| SANTANDER FC MASTER RF REF DI | 7.644.490,73 | 1,05% | | 8.782.612.732,17 | 0,09% | OK | OK | OK | 1,04% | 3,27% | 6,56% | 13,24% | 9,77% |
| FIDC | 5.950.422,87 | 0,82% | 2,00% | | | Art. 7o, Inciso VI | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1 | 5.950.422,87 | 0,82% | | 323.496.272,18 | 1,84% | OK | OK | OK | 1,27% | 4,00% | 8,03% | 16,42% | 12,08% |
| FIDC Fechado | 312.600,22 | 0,04% | 2,00% | | | Art. 7o, Inciso VII, Alínea A | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR | 185.293,00 | 0,03% | | 4.323.511,01 | 4,29% | OK | OK | OK | 306,19% | 364,30% | -18,19% | -17,28% | -13,03% |
| FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN | 127.307,22 | 0,02% | | 2.558.913,90 | 4,98% | OK | OK | OK | 27,00% | 5,47% | -4,88% | -21,49% | -11,62% |
| Fundo Crédito Privado | | | 5,00% | | | Art. 7o, Inciso VII, Alínea B | | | | | Alocação: | | |
| Fundos de Ações Referenciados | 42.015.664,95 | 5,78% | 15,00% | | | Art. 8o, Inciso I | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| GERACAO FIA PROGRAMADO | 5.775.564,49 | 0,79% | | 489.143.733,39 | 1,18% | OK | OK | OK | 0,95% | 12,58% | 11,01% | -0,23% | -1,22% |
| ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 27.799.812,44 | 3,82% | | 467.298.233,20 | 5,95% | OK | OK | OK | -0,22% | 9,62% | 16,08% | 25,10% | 28,10% |
| BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA | 8.440.288,02 | 1,16% | | 35.840.179,59 | 23,55% | OK | OK | OK | 1,33% | 14,17% | 19,41% | 27,21% | 31,04% |
| Fundos de Índices de Ações | 5.253.049,64 | 0,72% | 2,00% | | | Art. 8o, Inciso II | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA | 5.253.049,64 | 0,72% | | 25.704.547,88 | 20,44% | OK | OK | OK | 0,98% | 13,12% | 16,59% | 29,01% | 34,00% |
| Fundos de Ações | 41.941.416,03 | 5,77% | 15,00% | | | Art. 8o, Inciso III | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| ARX INCOME FI EM ACOES | 14.202.456,77 | 1,95% | | 124.516.162,62 | 11,41% | OK | OK | OK | -0,39% | 17,36% | 17,98% | 25,57% | 30,02% |
| AZ QUEST ACOES FC FIA | 2.732.471,69 | 0,38% | | 118.957.454,30 | 2,30% | OK | OK | OK | -0,20% | 15,48% | 15,32% | 18,21% | 23,59% |
| AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES | 11.813.909,89 | 1,62% | | 134.439.122,47 | 8,79% | OK | OK | OK | -1,43% | 6,52% | 15,18% | 18,00% | 17,29% |
| CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS | 5.728.739,00 | 0,79% | | 347.701.453,38 | 1,65% | OK | OK | OK | 0,02% | 6,05% | 8,70% | 20,22% | 12,91% |
| GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA | 3.106.708,82 | 0,43% | | 278.181.358,88 | 1,12% | OK | OK | OK | 0,93% | 11,81% | 8,36% | -2,96% | -2,15% |
| ITAU ACOES DIVIDENDOS FI | 4.357.129,86 | 0,60% | | 121.326.928,70 | 3,59% | OK | OK | OK | -0,89% | 13,11% | 18,83% | 26,01% | 30,70% |
| Fundos Multimercados | 5.229.926,77 | 0,72% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso IV | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO | 2.812.825,31 | 0,39% | | 146.381.862,98 | 1,92% | OK | OK | OK | 0,82% | 2,90% | 6,03% | 8,04% | 5,59% |
| WA US INDEX 500 FI MULTI | 2.417.101,46 | 0,33% | | 135.394.550,15 | 1,79% | OK | OK | OK | 0,79% | 6,65% | 12,17% | 27,71% | 14,81% |
| Fundos de Participações | 8.555.853,58 | 1,18% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso V | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP | 504.652,66 | 0,07% | | 227.436.492,19 | 0,22% | OK | OK | OK | -0,10% | -6,13% | -2,00% | -3,98% | -2,73% |
| FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II | 7.205.230,22 | 0,99% | | 51.157.134,52 | 14,08% | OK | OK | OK | 0,27% | 0,70% | -0,80% | -8,29% | -9,96% |
| BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP | 845.970,70 | 0,12% | | 213.635.806,00 | 0,40% | OK | OK | OK | -0,56% | -1,99% | -12,93% | 58,72% | -16,83% |
| Fundos de Investimento Imobiliários | 13.071.014,78 | 1,80% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso VI | | | | | Alocação: | Enquadrado | |
| DOMO FII | 6.200.000,00 | 0,85% | | 175.308.174,56 | 3,54% | OK | OK | OK | 18,77% | 19,24% | 7,08% | 19,23% | 5,98% |
| FII RB CAPITAL RENDA II | 6.871.014,78 | 0,94% | | 128.022.571,77 | 5,37% | OK | OK | OK | -1,43% | 6,41% | 9,32% | 0,09% | 7,30% |
| Disponibilidades Financeiras | 17.013,54 | 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.