



SBCPREV

31/10/2017

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	768.559.998,50	81,88%	159,00%						0,02%	2,66%	6,03%	14,97%	11,95%
RV	170.119.703,64	18,12%	41,00%						-0,49%	10,31%	17,82%	18,10%	27,49%
CONSOLIDADO	938.684.956,98	100,00%	200,00%						-0,07%	3,95%	7,99%	15,60%	14,44%
META ATUARIAL ( INPC + 6%)									0,86%	1,82%	3,57%	7,89%	5,64%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)									0,91%	2,27%	4,13%	8,81%	6,30%
<b>Títulos Públicos</b>	<b>164.672.179,36</b>	<b>17,54%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso I, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>		
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	164.672.179,36	17,54%							-0,24%	2,74%	6,19%	14,85%	12,45%
<b>Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham somente títulos públicos</b>			<b>50,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso I, Alínea B</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos de índice Renda fixa que contenham somente títulos públicos</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso I, Alínea C</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Operações Compromissadas</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso II</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos Referenciados Renda Fixa - IMA e IDKa</b>			<b>35,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso III, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos Índice Renda Fixa - IMA e IDKa</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso III, Alínea B</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos Renda Fixa - DI</b>	<b>596.969.724,15</b>	<b>63,60%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso IV, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>		
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	15.690.357,36	1,67%		202.880.948,68	7,73%	OK	OK	OK	0,25%	2,89%	4,88%	11,71%	10,40%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	29.065.860,25	3,10%		2.032.541.208,22	1,43%	OK	OK	OK	0,46%	2,71%	6,28%	13,30%	11,35%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	50.570.282,54	5,39%		1.302.197.028,29	3,88%	OK	OK	OK	-0,43%	2,76%	5,75%	14,57%	12,72%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	35.745.098,88	3,81%		5.074.617.880,11	0,70%	OK	OK	OK	0,08%	2,59%	6,60%	15,82%	13,44%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.502.702,92	1,44%		11.597.364.515,18	0,12%	OK	OK	OK	0,65%	2,32%	4,98%	11,62%	9,16%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	46.118.040,73	4,91%		1.454.981.601,25	3,17%	OK	OK	OK	-0,42%	2,81%	5,87%	14,85%	12,93%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	35.005.563,20	3,73%		321.114.531,17	10,90%	OK	OK	OK	0,38%	2,74%	6,31%	13,55%	11,60%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	147.713.951,14	15,74%		3.044.625.940,69	4,85%	OK	OK	OK	0,00%	2,46%	6,56%	15,72%	13,35%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	20.705.239,80	2,21%		2.697.066.187,08	0,77%	OK	OK	OK	-0,39%	2,77%	5,74%	14,09%	12,27%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	91.791.327,89	9,78%		6.365.966.293,35	1,44%	OK	OK	OK	0,46%	2,72%	6,25%	13,27%	11,31%
GF FC FI RF IMA B	13.600.674,54	1,45%		86.068.851,84	15,80%	OK	OK	Desenquadrado	-0,45%	2,59%	4,75%	13,44%	11,75%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	33.921.821,37	3,61%		1.525.423.588,30	2,22%	OK	OK	OK	0,04%	2,74%	5,18%	13,95%	11,84%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.723.283,57	0,72%		1.776.572.538,55	0,38%	OK	OK	OK	0,45%	2,66%	6,12%	13,04%	11,11%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	7.254.186,44	0,77%		8.594.856.994,83	0,08%	OK	OK	OK	0,64%	2,08%	4,72%	11,03%	8,71%
SAFRA IMA FIC FI RF	12.124.344,41	1,29%		401.603.202,23	3,02%	OK	OK	OK	-0,54%	2,69%	5,40%	13,89%	12,26%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	34.547.621,44	3,68%		1.203.243.656,67	2,87%	OK	OK	OK	0,46%	2,72%	6,21%	13,27%	11,29%
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	2.349.555,82	0,25%		7.020.033.916,78	0,03%	OK	OK	OK	0,65%	2,15%	4,83%	11,29%	8,90%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	539.811,85	0,06%		8.768.585.101,16	0,01%	OK	OK	OK	0,58%	1,95%	4,40%	10,41%	8,18%
<b>Fundos de Índice Renda Fixa - DI</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso IV, Alínea B</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Letras Imobiliárias Garantidas</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso V</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Certificado de Depósito Bancário (CDB)</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso VI, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Depósito Poupança</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso VI, Alínea B</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>FIDC Cota Sênior</b>	<b>6.918.094,99</b>	<b>0,74%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso VII, Alínea A</b>					<b>Alocação:</b>		
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	34.539,23	0,00%		805.916,73	4,29%	OK	OK	OK	-6,90%	40,90%	16,73%	-29,22%	-92,46%
FIDC TRENBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	85.909,12	0,01%		1.726.799,57	4,98%	OK	OK	OK	-3,61%	-8,24%	-18,02%	-30,84%	-26,36%
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	6.797.646,64	0,72%		405.572.243,57	1,68%	OK	OK	OK	0,98%	3,20%	7,05%	14,59%	11,79%
<b>Fundos Crédito Privado</b>			<b>1,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso VII, Alínea B</b>					<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos Lei nº12.431</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 7º, Inciso VII, Alínea C</b>					<b>Alocação:</b>		

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV**

**31/10/2017**

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	768.559.998,50	81,88%	159,00%						0,02%	2,66%	6,03%	14,97%	11,95%
RV	170.119.703,64	18,12%	41,00%						-0,49%	10,31%	17,82%	18,10%	27,49%
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>938.684.956,98</b>	<b>100,00%</b>	<b>200,00%</b>						<b>-0,07%</b>	<b>3,95%</b>	<b>7,99%</b>	<b>15,60%</b>	<b>14,44%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)									0,86%	1,82%	3,57%	7,89%	5,64%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)									0,91%	2,27%	4,13%	8,81%	6,30%
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>34.907.601,09</b>	<b>3,72%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	34.907.601,09	3,72%		580.590.845,74	6,01%	OK	OK	OK	-0,85%	11,00%	12,64%	14,87%	24,16%
<b>Fundos de índices de Renda Variável</b>			<b>0,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>81.686.404,23</b>	<b>8,70%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso II, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	20.075.043,01	2,14%		166.651.076,70	12,05%	OK	OK	OK	-0,42%	13,32%	12,48%	10,05%	22,21%
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.825.955,07	0,62%		175.543.420,70	3,32%	OK	OK	OK	0,26%	15,25%	16,06%	12,77%	23,64%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	25.289.620,43	2,69%		372.190.680,14	6,79%	OK	OK	OK	0,19%	15,01%	20,49%	30,64%	39,76%
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	10.627.015,55	1,13%		51.109.055,56	20,79%	OK	OK	Desenquadrado	-0,01%	11,55%	15,63%	14,65%	21,69%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.694.200,74	0,71%		394.392.774,00	1,70%	OK	OK	OK	-0,70%	10,46%	8,52%	9,68%	17,41%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	9.043.412,24	0,96%		178.051.409,15	5,08%	OK	OK	OK	0,02%	12,68%	7,11%	15,56%	19,27%
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	4.131.157,19	0,44%		379.576.423,69	1,09%	OK	OK	OK	-3,85%	1,78%	11,16%	9,08%	19,33%
<b>Fundos de índices de Renda Variável</b>	<b>6.657.362,71</b>	<b>0,71%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso II, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	6.657.362,71	0,71%		34.584.624,84	19,25%	OK	OK	Desenquadrado	0,01%	12,46%	13,24%	14,26%	22,75%
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>14.882.906,86</b>	<b>1,59%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	8.468.160,80	0,90%		34.391.321,12	24,62%	OK	OK	Desenquadrado	0,68%	3,44%	-	-	-
WA US INDEX 500 FI MULTI	6.414.746,06	0,68%		578.119.260,78	1,11%	OK	OK	OK	2,74%	5,99%	12,40%	32,80%	23,19%
<b>Fundos de Participação</b>	<b>15.862.931,59</b>	<b>1,69%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	466.235,58	0,05%		210.122.707,42	0,22%	OK	OK	OK	-0,12%	-6,64%	-6,94%	-7,53%	-7,35%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	724.119,60	0,08%		183.847.498,42	0,39%	OK	OK	OK	-0,53%	-	-	-	-
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.672.576,41	1,56%		104.175.292,50	14,08%	OK	OK	Desenquadrado	-0,62%	-0,54%	124,87%	92,88%	127,59%
<b>Fundos Imobiliários</b>	<b>16.122.497,16</b>	<b>1,72%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8º, Inciso IV, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	
DOMO FII	7.000.000,00	0,75%		150.425.018,56	4,65%	OK	OK	OK	-6,67%	70,73%	55,04%	12,90%	44,63%
FII RB CAPITAL RENDA II	9.122.497,16	0,97%		134.950.467,35	6,76%	OK	OK	Desenquadrado	3,40%	-1,44%	12,28%	33,32%	30,25%
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>5.254,84</b>	<b>0,00%</b>											

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.