

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

28/04/2017

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	703.661.292,54		159,00%						0,18%	3,99%	8,43%	15,13%	5,58%
RV	132.523.613,90		41,00%						0,56%	1,68%	0,23%	19,21%	8,20%
CONSOLIDADO	836.201.885,17		200,00%						0,24%	3,63%	7,24%	16,24%	6,13%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,50%	2,00%	4,17%	10,20%	2,95%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,56%	2,08%	4,50%	10,30%	2,99%
Títulos Públicos	166.075.651,36	19,86%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA SBCPREV	166.075.651,36	19,86%							-0,40%	4,08%	8,15%	12,90%	5,89%
Fundos que contenham somente títulos públicos	286.903.240,55	34,31%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M FI	28.179.663,39	3,37%		4.888.848.685,76	0,58%	OK	OK	OK	0,50%	4,03%	8,65%	17,43%	6,42%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	99.194.915,81	11,86%		2.954.876.504,25	3,36%	OK	OK	OK	0,47%	3,98%	8,60%	17,47%	6,38%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	82.348.458,21	9,85%		6.002.868.089,38	1,37%	OK	OK	OK	0,70%	3,59%	6,62%	12,96%	4,77%
GF FC FI RF IMA B	12.984.006,51	1,55%		101.160.906,82	12,84%	OK	OK	OK	-0,26%	4,69%	8,30%	16,59%	6,68%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.335.298,58	0,76%		1.985.311.997,03	0,32%	OK	OK	OK	0,68%	3,54%	6,52%	12,74%	4,70%
SAFRA IMA FIC FI RF	9.097.187,11	1,09%		445.606.956,10	2,04%	OK	OK	OK	-0,27%	4,73%	8,05%	15,95%	6,50%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	48.763.710,94	5,83%		1.256.721.602,79	3,88%	OK	OK	OK	0,70%	3,60%	6,64%	12,98%	4,78%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	176.393.585,41	21,09%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B 5 LP FC	40.399.679,33	4,83%		2.024.939.500,31	2,00%	OK	OK	OK	0,70%	3,60%	6,61%	12,97%	4,78%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B FI	47.819.896,65	5,72%		1.255.696.969,80	3,81%	OK	OK	OK	-0,35%	4,61%	8,34%	16,62%	6,59%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	43.559.703,47	5,21%		1.643.582.236,81	2,65%	OK	OK	OK	-0,39%	4,65%	8,48%	16,92%	6,67%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	25.032.607,26	2,99%		271.497.509,28	9,22%	OK	OK	OK	0,66%	3,76%	6,80%	13,09%	4,97%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	19.581.698,70	2,34%		2.558.421.323,46	0,77%	OK	OK	OK	-0,53%	4,21%	7,90%	16,38%	6,18%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	67.707.674,28	8,10%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.549.560,67	1,50%		182.490.790,21	6,88%	OK	OK	OK	0,79%	4,57%	7,02%	13,99%	5,77%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.862.201,32	1,54%		8.466.633.870,60	0,15%	OK	OK	OK	0,91%	2,86%	6,33%	13,90%	3,98%
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	32.250.750,96	3,86%		1.382.253.366,36	2,33%	OK	OK	OK	0,21%	4,12%	8,33%	16,73%	6,33%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	10.045.161,33	1,20%		8.627.554.708,01	0,12%	OK	OK	OK	0,74%	2,56%	5,75%	12,69%	3,62%
FIDC	6.446.756,14	0,77%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6.446.756,14	0,77%		394.265.382,01	1,64%	OK	OK	OK	0,91%	3,15%	7,05%	15,63%	4,44%
FIDC Fechado	134.384,80	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	29.587,90	0,00%		690.385,59	4,29%	OK	OK	OK	-9,05%	-46,19%	-39,36%	414,56%	-93,54%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	104.796,90	0,01%		2.106.449,59	4,98%	OK	OK	OK	-3,04%	-8,73%	-15,63%	-19,86%	-10,17%
Fundo Crédito Privado			1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	48.610.539,85	5,81%	15,00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.190.850,46	1,10%		43.702.996,38	21,03%	OK	OK	OK	1,03%	0,12%	-0,85%	20,17%	5,24%
GERAÇÃO FIA PROGRAMADO	8.430.294,72	1,01%		497.098.242,75	1,70%	OK	OK	OK	-1,26%	-2,71%	-2,30%	18,89%	3,35%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	30.989.394,67	3,71%		531.474.958,92	5,83%	OK	OK	OK	1,18%	2,76%	1,98%	22,49%	10,22%
Fundos de Índices de Ações	5.878.995,85	0,70%	2,00%			Art. 8o, Inciso II					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.878.995,85	0,70%		24.181.993,10	24,31%	OK	OK	OK	0,70%	1,13%	0,90%	21,20%	8,40%
Fundos de Ações	51.781.398,47	6,19%	15,00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.848.112,33	2,13%		147.142.584,35	12,13%	OK	OK	OK	0,23%	0,51%	-2,16%	22,97%	8,66%
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.019.735,78	0,60%		129.909.989,49	3,86%	OK	OK	OK	1,05%	-0,85%	-2,83%	19,91%	6,53%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	14.005.825,92	1,67%		227.765.780,00	6,15%	OK	OK	OK	1,75%	4,84%	8,42%	30,86%	15,99%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.168.877,23	0,74%		374.415.364,35	1,65%	OK	OK	OK	1,81%	5,23%	1,07%	13,17%	8,20%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.217.488,32	0,38%		245.766.598,42	1,31%	OK	OK	OK	-1,39%	-1,73%	-6,24%	10,67%	3,03%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.521.358,89	0,66%		167.659.619,19	3,29%	OK	OK	OK	-0,46%	4,01%	7,89%	39,03%	11,35%
Fundos Multimercados	5.867.350,55	0,70%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Enquadrado	
GERAÇÃO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.034.510,36	0,36%		127.654.213,49	2,38%	OK	OK	OK	0,74%	2,49%	5,44%	13,82%	4,24%
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.832.840,19	0,34%		199.754.134,70	1,42%	OK	OK	OK	1,60%	7,41%	18,15%	29,87%	9,59%
Fundos de Participações	7.742.974,28	0,93%	3,00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	500.994,89	0,06%		225.788.006,95	0,22%	OK	OK	OK	-0,09%	-0,35%	-0,63%	-7,03%	-0,44%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	752.775,43	0,09%		190.100.932,10	0,40%	OK	OK	OK	-0,51%	-5,60%	-5,25%	-17,78%	-4,17%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.489.203,96	0,78%		46.073.348,21	14,08%	OK	OK	OK	0,30%	1,09%	-14,23%	-11,33%	1,21%
Fundos de Investimento Imobiliários	12.642.354,90	1,51%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.515.000,00	0,54%		166.588.213,24	2,71%	OK	OK	OK	-8,66%	-7,29%	-27,18%	-22,16%	-6,71%
FII RB CAPITAL RENDA II	8.127.354,90	0,97%		136.734.890,65	5,99%	OK	OK	OK	3,42%	3,98%	18,01%	26,12%	15,24%
Disponibilidades Financeiras	16.978,73	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.