

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

31/08/2017

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	750.416.233,11	82,60%	159,00%							1,25%	4,94%	6,07%	15,83%	10,41%
RV	158.043.412,06	17,40%	41,00%							5,12%	16,28%	10,65%	24,03%	21,49%
CONSOLIDADO	908.466.831,55	100,00%	200,00%							1,90%	6,76%	6,86%	17,40%	12,20%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,50%	1,35%	3,60%	7,79%	4,28%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,72%	1,72%	3,91%	8,55%	4,69%
Títulos Públicos	162.591.922,81	17,90%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	162.591.922,81	17,90%								1,45%	5,52%	5,56%	15,67%	11,03%
Fundos que contenham somente títulos públicos	318.100.207,29	35,02%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	34.384.279,76	3,78%		5.019.690.527,82	0,68%	OK	OK	OK	1,04%	4,73%	7,08%	17,74%	11,73%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	111.542.493,98	12,28%		2.824.183.322,38	3,95%	OK	OK	OK	1,01%	4,73%	7,05%	17,80%	11,75%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	90.472.329,04	9,96%		6.296.856.629,93	1,44%	OK	OK	OK	1,24%	4,63%	6,90%	13,72%	9,71%	
GF FC FI RF IMA B	13.423.045,00	1,48%		102.235.718,28	13,13%	OK	OK	OK	1,25%	5,43%	4,25%	14,90%	10,29%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.628.575,16	0,73%		1.872.929.085,37	0,35%	OK	OK	OK	1,22%	4,60%	6,77%	13,46%	9,55%	
SAFRA IMA FIC FI RF	11.972.407,50	1,32%		404.089.458,00	2,96%	OK	OK	OK	1,41%	5,87%	5,08%	14,94%	10,85%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	49.677.076,85	5,47%		1.321.921.132,04	3,76%	OK	OK	OK	1,24%	4,62%	6,86%	13,68%	9,68%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa	193.929.268,01	21,35%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	43.635.066,53	4,80%		1.913.155.812,65	2,28%	OK	OK	OK	1,24%	4,66%	6,94%	13,74%	9,76%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	49.868.747,36	5,49%		1.230.094.705,05	4,05%	OK	OK	OK	1,33%	5,59%	5,01%	15,58%	11,15%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	45.481.370,04	5,01%		1.661.474.640,17	2,74%	OK	OK	OK	1,39%	5,66%	5,12%	15,97%	11,37%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	34.522.715,85	3,80%		307.254.569,12	11,24%	OK	OK	OK	1,33%	4,80%	7,07%	14,11%	10,06%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	20.421.368,23	2,25%		2.615.993.378,51	0,78%	OK	OK	OK	1,36%	5,30%	4,72%	15,18%	10,73%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	68.950.909,01	7,59%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.877.402,88	1,42%		195.501.022,55	6,59%	OK	OK	OK	1,15%	3,75%	5,00%	11,86%	8,53%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.326.475,45	1,47%		11.675.947.076,19	0,11%	OK	OK	OK	0,99%	2,65%	5,65%	12,68%	7,74%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	33.405.465,81	3,68%		1.502.261.222,00	2,22%	OK	OK	OK	1,18%	4,75%	5,16%	15,38%	10,13%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	7.162.629,34	0,79%		7.815.984.089,09	0,09%	OK	OK	OK	0,79%	2,46%	5,29%	11,97%	7,34%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	1.567.845,99	0,17%		6.475.185.535,55	0,02%	OK	OK	OK	0,84%	2,51%	5,42%	12,24%	7,50%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	611.089,54	0,07%		8.805.020.134,49	0,01%	OK	OK	OK	0,76%	2,30%	4,99%	11,36%	6,93%	
FIDC	6.698.074,04	0,74%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	6.698.074,04	0,74%		399.312.508,16	1,68%	OK	OK	OK	1,18%	3,63%	7,18%	15,15%	9,60%	
FIDC Fechado	145.851,95	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	64.794,99	0,01%		1.511.885,73	4,29%	OK	OK	OK	164,33%	134,60%	79,79%	710,72%	-85,86%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	81.056,96	0,01%		1.629.269,58	4,98%	OK	OK	OK	-13,42%	-20,10%	-27,20%	-19,14%	-30,52%	
Fundo Crédito Privado			1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	52.016.680,55	5,73%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	10.171.306,09	1,12%		48.752.465,13	20,86%	OK	OK	OK	6,76%	13,28%	7,59%	22,11%	16,47%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	8.293.580,13	0,91%		370.904.640,17	2,24%	OK	OK	OK	1,62%	4,58%	-5,06%	9,11%	1,68%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	33.551.794,33	3,69%		560.417.787,47	5,99%	OK	OK	OK	6,69%	12,89%	7,50%	20,43%	19,34%	
Fundos de Índices de Ações	6.352.893,34	0,70%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	6.352.893,34	0,70%		28.344.960,93	22,41%	OK	OK	OK	7,32%	12,59%	5,99%	22,13%	17,14%	
Fundos de Ações	55.898.233,97	6,15%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	19.339.491,12	2,13%		149.195.327,58	12,96%	OK	OK	OK	9,17%	14,06%	5,61%	19,55%	17,74%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.461.050,37	0,60%		122.733.654,37	4,45%	OK	OK	OK	8,03%	15,41%	5,60%	17,90%	15,90%	
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	15.917.632,89	1,75%		296.302.977,49	5,37%	OK	OK	OK	8,47%	19,20%	12,93%	33,04%	31,83%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.454.491,34	0,71%		393.089.207,90	1,64%	OK	OK	OK	6,51%	8,22%	5,42%	12,69%	13,21%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.149.970,07	0,35%		130.301.876,23	2,42%	OK	OK	OK	1,27%	3,42%	-5,35%	2,34%	0,86%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.575.598,18	0,61%		159.504.407,99	3,50%	OK	OK	OK	6,23%	10,23%	-2,35%	26,83%	12,44%	
Fundos Multimercados	14.495.660,32	1,60%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.126.942,93	0,34%		114.226.944,67	2,74%	OK	OK	OK	0,99%	3,19%	4,45%	12,08%	7,42%	
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	8.332.156,80	0,92%		33.838.974,47	24,62%	OK	OK	OK	1,78%	-	-	-	-	
WA US INDEX 500 FI MULTI	3.036.560,59	0,33%		421.741.066,33	0,72%	OK	OK	OK	1,08%	4,88%	9,90%	26,62%	17,48%	
Fundos de Participações	15.870.868,03	1,75%	3,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	467.352,40	0,05%		210.626.045,23	0,22%	OK	OK	OK	-6,42%	-6,61%	-6,96%	-7,48%	-7,13%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	732.481,94	0,08%		184.976.305,09	0,40%	OK	OK	OK	-0,75%	-2,06%	-3,82%	-8,80%	-6,76%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.671.033,69	1,61%		104.164.339,30	14,08%	OK	OK	OK	0,00%	126,61%	128,44%	102,85%	128,81%	
Fundos de Investimento Imobiliários	13.409.075,85	1,48%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.510.000,00	0,50%		160.046.380,86	2,82%	OK	OK	OK	10,00%	10,00%	-13,27%	-1,96%	-6,82%	
FII RB CAPITAL RENDA II	8.899.075,85	0,98%		138.454.849,67	6,43%	OK	OK	OK	-4,02%	0,67%	14,20%	27,08%	26,85%	
Disponibilidades Financeiras	7.186,38	0,001%												

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.