



SBCPREV

29/12/2017

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	796.199.959,75	82,31%	159,00%						0,92%	0,74%	6,54%	12,75%	12,75%
RV	171.125.834,76	16,99%	41,00%						4,78%	0,33%	22,65%	28,53%	28,53%
CONSOLIDADO	967.328.432,13	100,00%	200,00%						1,59%	0,68%	9,13%	15,30%	15,30%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,72%	2,24%	3,89%	8,11%	8,11%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,91%	2,58%	4,73%	9,05%	9,05%
Títulos Públicos	160.884.165,97	16,63%	40,00%			Art. 7º, Inciso I, Alínea A					Alocação:		
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	160.884.165,97	16,63%							0,90%	-0,01%	6,78%	12,71%	12,71%
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham somente títulos públicos	360.679.262,42	37,29%	50,00%			Art. 7º, Inciso I, Alínea B					Alocação:		
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	46.180.136,77	4,77%		4.707.912.251,54	0,98%	OK	OK	OK	1,22%	1,37%	6,31%	14,91%	14,91%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	153.780.204,51	15,90%		2.638.455.038,83	5,83%	OK	OK	OK	1,19%	1,27%	6,17%	14,80%	14,80%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	92.671.515,23	9,58%		6.666.405.048,53	1,39%	OK	OK	OK	0,87%	1,42%	6,63%	12,38%	12,38%
GF FC FI RF IMA B	13.600.010,52	1,41%		65.985.981,50	20,61%	OK	OK	Desenquadrado	0,81%	-0,45%	6,69%	11,75%	11,75%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.785.380,11	0,70%		1.738.380.542,12	0,39%	OK	OK	OK	0,85%	1,38%	6,52%	12,14%	12,14%
SAFRA IMA FIC FI RF	12.132.978,98	1,25%		350.442.768,39	3,46%	OK	OK	OK	0,84%	-0,46%	7,18%	12,34%	12,34%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	35.529.036,30	3,67%		1.269.069.386,21	2,80%	OK	OK	OK	0,87%	1,45%	6,66%	12,38%	12,38%
Fundos de Índice Renda fixa que contenham somente títulos públicos			0,00%			Art. 7º, Inciso I, Alínea C					Alocação:		
Operações Compromissadas			0,00%			Art. 7º, Inciso II					Alocação:		
Fundos Referenciados Renda Fixa - IMA e IDkA			35,00%			Art. 7º, Inciso III, Alínea A					Alocação:		
Fundos Índice Renda Fixa - IMA e IDkA			0,00%			Art. 7º, Inciso III, Alínea B					Alocação:		
Fundos Renda Fixa - DI	267.580.681,81	27,66%	30,00%			Art. 7º, Inciso IV, Alínea A					Alocação:		
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	15.895.928,05	1,64%		213.504.727,15	7,45%	OK	OK	OK	0,64%	1,56%	5,91%	11,85%	11,85%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	38.721.343,98	4,00%		2.141.105.909,20	1,81%	OK	OK	OK	0,87%	1,42%	6,65%	12,42%	12,42%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	50.606.951,21	5,23%		1.070.534.298,25	4,73%	OK	OK	OK	0,85%	-0,36%	6,95%	12,80%	12,80%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.650.001,05	1,41%		9.371.259.094,82	0,15%	OK	OK	OK	0,53%	1,75%	4,28%	10,35%	10,35%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	46.130.886,56	4,77%		1.455.106.344,45	3,17%	OK	OK	OK	0,85%	-0,39%	7,01%	12,96%	12,96%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	35.336.892,80	3,65%		323.458.894,79	10,92%	OK	OK	OK	0,87%	1,33%	6,76%	12,66%	12,66%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	20.721.844,05	2,14%		2.480.853.390,51	0,84%	OK	OK	OK	0,82%	-0,31%	6,73%	12,36%	12,36%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	34.236.770,50	3,54%		1.451.065.616,52	2,36%	OK	OK	OK	0,80%	0,97%	6,32%	12,87%	12,87%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	7.333.119,17	0,76%		8.702.401.390,30	0,08%	OK	OK	OK	0,53%	1,74%	4,02%	9,89%	9,89%
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	4.258.321,11	0,44%		6.666.050.136,27	0,06%	OK	OK	OK	0,53%	1,75%	4,10%	10,10%	10,10%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	688.623,33	0,07%		8.501.152.466,41	0,01%	OK	OK	OK	0,47%	1,56%	3,69%	9,23%	9,23%
Fundos de Índice Renda Fixa - DI			0,00%			Art. 7º, Inciso IV, Alínea B					Alocação:		
Letras Imobiliárias Garantidas			0,00%			Art. 7º, Inciso V					Alocação:		
Certificado de Depósito Bancário (CDB)			0,00%			Art. 7º, Inciso VI, Alínea A					Alocação:		
Depósito Poupança			0,00%			Art. 7º, Inciso VI, Alínea B					Alocação:		
FIDC Cota Sênior	7.055.849,55	0,73%	3,00%			Art. 7º, Inciso VII, Alínea A					Alocação:		
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	91.854,05	0,01%		2.143.264,92	4,29%	OK	OK	OK	143,59%	147,60%	269,17%	-79,95%	-79,95%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	79.504,07	0,01%		1.598.806,27	4,97%	OK	OK	OK	-3,84%	-10,76%	-18,26%	-31,82%	-31,82%
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	6.884.491,43	0,71%		403.861.018,29	1,70%	OK	OK	OK	0,59%	2,41%	5,93%	13,37%	13,37%
Fundos Crédito Privado			1,00%			Art. 7º, Inciso VII, Alínea B					Alocação:		
Fundos Lei nº12.431			0,00%			Art. 7º, Inciso VII, Alínea C					Alocação:		

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

29/12/2017

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	796.199.959,75	82,31%	159,00%						0,92%	0,74%	6,54%	12,75%	12,75%
RV	171.125.834,76	16,99%	41,00%						4,78%	0,33%	22,65%	28,53%	28,53%
CONSOLIDADO	967.328.432,13	100,00%	200,00%						1,59%	0,68%	9,13%	15,30%	15,30%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,72%	2,24%	3,89%	8,11%	8,11%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,91%	2,58%	4,73%	9,05%	9,05%
Fundos de Ações Referenciados	98.004.871,91	10,13%	15,00%			Art. 8º, Inciso I, Alínea A					Alocação:		
ARX INCOME FI EM ACOES	20.255.545,42	2,09%		166.276.343,32	12,18%	OK	OK	OK	6,26%	0,48%	19,46%	23,31%	23,31%
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.868.417,85	0,61%		183.863.771,81	3,19%	OK	OK	OK	6,25%	0,99%	23,76%	24,54%	24,54%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	25.492.368,50	2,64%		424.192.021,43	6,01%	OK	OK	OK	5,02%	0,99%	28,26%	40,89%	40,89%
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	10.766.794,02	1,11%		55.210.030,37	19,50%	OK	OK	Desenquadrado	5,96%	1,31%	17,84%	23,29%	23,29%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	35.621.746,12	3,68%		605.134.812,81	5,89%	OK	OK	OK	5,79%	1,18%	18,81%	26,70%	26,70%
Fundos de índices de Renda Variável	6.823.912,58	0,71%	0,00%			Art. 8º, Inciso I, Alínea B					Alocação:		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	6.823.912,58	0,71%		37.698.057,78	18,10%	OK	OK	Desenquadrado	6,19%	2,51%	20,76%	25,83%	25,83%
Fundos de Ações	20.072.216,42	2,08%	15,00%			Art. 8º, Inciso II, Alínea A					Alocação:		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.825.497,57	0,71%		382.439.702,61	1,78%	OK	OK	OK	5,23%	1,25%	14,58%	19,71%	19,71%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	8.953.995,93	0,93%		172.183.048,90	5,20%	OK	OK	OK	5,32%	-0,97%	17,24%	18,09%	18,09%
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	4.292.722,92	0,44%		376.978.123,86	1,14%	OK	OK	OK	5,72%	-0,09%	10,68%	24,00%	24,00%
Fundos de índices de Renda Variável			2,00%			Art. 8º, Inciso II, Alínea B					Alocação:		
Fundos Multimercados	15.287.477,47	1,58%	3,00%			Art. 8º, Inciso III					Alocação:		
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	8.546.887,20	0,88%		34.711.047,05	24,62%	OK	OK	Desenquadrado	0,85%	1,61%	6,53%	-	-
WA US INDEX 500 FI MULTI	6.740.590,27	0,70%		946.407.676,08	0,71%	OK	OK	OK	1,71%	7,96%	14,28%	29,44%	29,44%
Fundos de Participação	16.009.100,70	1,65%	3,00%			Art. 8º, Inciso IV, Alínea A					Alocação:		
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	465.167,44	0,05%		209.641.323,51	0,22%	OK	OK	OK	-0,11%	-0,35%	-6,96%	-7,56%	-7,56%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	744.863,49	0,08%		183.847.498,42	0,41%	OK	OK	OK	3,67%	-	-	-	-
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.799.069,77	1,53%		104.164.339,30	14,21%	OK	OK	Desenquadrado	0,22%	-	-	-	-
Fundos Imobiliários	14.928.255,68	1,54%	3,00%			Art. 8º, Inciso IV, Alínea B					Alocação:		
DOMO FII	6.190.000,00	0,64%		153.397.209,24	4,04%	OK	OK	OK	12,13%	-17,47%	54,75%	27,89%	27,89%
FII RB CAPITAL RENDA II	8.738.255,68	0,90%		136.935.653,76	6,38%	OK	OK	Desenquadrado	1,95%	-1,81%	-3,13%	23,69%	23,69%
Disponibilidades Financeiras	2.637,62	0,00%											

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.