

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

24/02/2017

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	681.022.418,96	83,50%	159,00%						2,53%	7,14%	9,20%	19,04%	4,10%
RV	134.528.621,71	16,50%	41,00%						3,18%	8,50%	12,09%	35,46%	9,80%
CONSOLIDADO	815.576.656,20	100,00%	200,00%						2,64%	7,49%	10,03%	22,03%	5,11%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,73%	2,28%	4,11%	10,98%	1,64%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,82%	2,50%	4,54%	11,04%	1,69%
Títulos Públicos	164.977.357,39	20,23%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	164.977.357,39	20,23%							3,38%	8,33%	9,58%	22,61%	5,18%
Fundos que contenham somente títulos públicos	263.430.247,66	32,30%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	22.431.171,98	2,75%		4.731.281.971,71	0,47%	OK	OK	OK	2,01%	6,23%	9,96%	23,21%	4,35%
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	12.875.696,99	1,58%		81.102.227,99	15,88%	OK	OK	OK	3,82%	8,79%	10,22%	25,97%	5,79%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	93.481.246,08	11,46%		2.443.034.104,21	3,83%	OK	OK	OK	2,04%	6,28%	10,04%	23,40%	4,39%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	80.667.908,68	9,89%		5.626.003.834,34	1,43%	OK	OK	OK	1,48%	4,05%	6,38%	13,17%	2,63%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.208.388,10	0,76%		1.942.005.717,06	0,32%	OK	OK	OK	1,46%	4,00%	6,27%	12,95%	2,60%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	47.765.835,83	5,86%		1.333.978.210,51	3,58%	OK	OK	OK	1,48%	4,06%	6,38%	13,19%	2,64%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	182.854.476,46	22,42%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	39.572.956,88	4,85%		1.940.029.510,25	2,04%	OK	OK	OK	1,48%	4,03%	6,35%	13,21%	2,63%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	46.988.920,12	5,76%		1.284.102.751,60	3,66%	OK	OK	OK	3,89%	8,91%	10,06%	26,52%	5,85%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	43.268.097,08	5,31%		1.638.161.922,05	2,64%	OK	OK	OK	3,95%	9,14%	10,32%	27,01%	5,95%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	24.512.965,88	3,01%		258.985.451,60	9,46%	OK	OK	OK	1,60%	4,26%	6,58%	13,40%	2,79%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	19.500.354,13	2,39%		2.528.652.551,60	0,77%	OK	OK	OK	3,78%	8,70%	9,99%	26,42%	5,74%
SAFRA IMA FIC FI RF	9.011.182,37	1,10%		400.376.378,91	2,25%	OK	OK	OK	3,74%	8,40%	9,38%	24,35%	5,50%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	63.300.499,67	7,76%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.264.305,80	1,50%		172.479.385,98	7,11%	OK	OK	OK	2,20%	4,79%	6,53%	14,79%	3,36%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.613.711,30	1,55%		7.584.324.320,29	0,17%	OK	OK	OK	0,87%	3,12%	6,65%	14,17%	1,98%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	31.765.518,59	3,89%		1.361.585.761,94	2,33%	OK	OK	OK	2,55%	6,95%	9,72%	23,39%	4,73%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	6.656.963,98	0,82%		8.666.878.243,14	0,08%	OK	OK	OK	0,81%	2,92%	6,06%	13,06%	1,84%
FIDC	6.312.454,00	0,77%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	6.312.454,00	0,77%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-
FIDC Fechado	147.383,78	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	36.039,11	0,00%		840.914,16	4,29%	OK	OK	OK	-34,46%	-4,31%	350,92%	604,21%	-92,13%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	111.344,67	0,01%		2.238.061,74	4,98%	OK	OK	OK	-3,03%	-8,02%	11,07%	-18,25%	-4,55%
Fundo Crédito Privado			1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações Referenciados	49.400.650,05	6,06%	15,00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.454.084,73	1,16%		40.768.413,74	23,19%	OK	OK	OK	2,99%	6,75%	13,50%	50,47%	8,26%
GERACAO FIA PROGRAMADO	8.735.666,50	1,07%		551.302.733,30	1,58%	OK	OK	OK	0,81%	8,62%	14,93%	19,70%	7,10%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	31.210.898,82	3,83%		534.697.877,39	5,84%	OK	OK	OK	3,50%	9,35%	12,03%	43,11%	11,01%
Fundos de Índices de Ações	5.994.087,96	0,73%	2,00%			Art. 8o, Inciso II					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.994.087,96	0,73%		27.354.639,74	21,91%	OK	OK	OK	3,11%	7,56%	15,23%	55,08%	10,52%
Fundos de Ações	52.739.316,64	6,47%	15,00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	18.311.931,11	2,25%		144.035.447,38	12,71%	OK	OK	OK	3,13%	6,57%	13,20%	49,76%	11,48%
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.171.538,08	0,63%		126.903.358,26	4,08%	OK	OK	OK	2,15%	7,81%	11,65%	40,29%	9,76%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	14.095.562,58	1,73%		176.965.421,54	7,97%	OK	OK	OK	5,52%	19,38%	17,81%	39,63%	16,74%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.122.684,96	0,75%		371.611.684,93	1,65%	OK	OK	OK	4,44%	6,82%	6,89%	20,71%	7,39%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.328.014,63	0,41%		277.183.886,32	1,20%	OK	OK	OK	1,64%	8,93%	8,12%	8,78%	6,56%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.709.585,28	0,70%		152.600.191,72	3,74%	OK	OK	OK	7,56%	14,26%	29,88%	77,60%	15,14%
Fundos Multimercados	5.756.904,01	0,71%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.993.761,82	0,37%		131.923.759,06	2,27%	OK	OK	OK	1,11%	3,56%	7,31%	11,33%	2,84%
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.763.142,19	0,34%		164.596.062,50	1,68%	OK	OK	OK	4,77%	10,28%	15,22%	37,79%	6,90%
Fundos de Participações	7.644.900,45	0,94%	3,00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	502.327,90	0,06%		226.388.765,57	0,22%	OK	OK	OK	-0,09%	-0,28%	-0,56%	-2,38%	-0,18%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	761.597,62	0,09%		192.328.987,20	0,40%	OK	OK	OK	-14,12%	-13,34%	-14,73%	-28,41%	-12,82%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.380.974,93	0,78%		45.304.922,04	14,08%	OK	OK	OK	0,05%	-0,08%	-11,20%	-6,38%	0,16%
Fundos de Investimento Imobiliários	12.992.762,60	1,59%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.200.000,00	0,64%		164.159.583,26	3,17%	OK	OK	OK	6,77%	-4,94%	-0,38%	-10,34%	7,44%
FII RB CAPITAL RENDA II	7.792.762,60	0,96%		135.826.332,85	5,74%	OK	OK	OK	0,28%	13,20%	11,28%	40,74%	11,08%
Disponibilidades Financeiras	25.615,53	0,003%											

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.