

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

31/01/2017

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	659.328.730,74	83,49%	159,00%						1,53%	4,27%	7,67%	18,18%	1,53%
RV	130.395.796,21	16,51%	41,00%						6,41%	-1,43%	9,47%	34,55%	6,41%
CONSOLIDADO	789.735.718,19	100,00%	200,00%						2,41%	3,48%	8,31%	21,14%	2,41%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,91%	2,11%	4,19%	11,76%	0,91%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,87%	2,34%	4,66%	11,68%	0,87%
Títulos Públicos	159.578.553,87	20,21%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	159.578.553,87	20,21%							1,74%	3,91%	7,32%	21,60%	1,74%
Fundos que contenham somente títulos públicos	242.857.989,52	30,75%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	1.513.862,80	0,19%		4.027.807.080,47	0,04%	OK	OK	OK	2,29%	4,44%	8,85%	22,68%	2,29%
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	12.402.257,66	1,57%		70.833.796,00	17,51%	OK	OK	OK	1,90%	3,45%	6,88%	24,17%	1,90%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	67.640.640,64	8,56%		1.828.407.855,08	3,70%	OK	OK	OK	2,31%	4,44%	8,91%	22,88%	2,31%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	99.427.177,97	12,59%		5.503.989.684,97	1,81%	OK	OK	OK	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	1,14%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.118.852,54	0,77%		1.926.319.580,43	0,32%	OK	OK	OK	1,12%	2,88%	5,85%	13,00%	1,12%
SAFRA IMA FIC FI RF	8.686.446,10	1,10%		371.329.753,80	2,34%	OK	OK	OK	1,70%	3,17%	6,28%	22,44%	1,70%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	47.068.751,81	5,96%		1.346.983.945,44	3,49%	OK	OK	OK	1,14%	2,94%	5,97%	13,23%	1,14%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	189.173.782,16	23,95%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	58.921.126,52	7,46%		2.055.840.281,62	2,87%	OK	OK	OK	1,14%	2,91%	5,97%	13,25%	1,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	45.712.767,48	5,79%		1.176.665.634,64	3,88%	OK	OK	OK	1,89%	3,56%	6,99%	24,48%	1,89%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	41.622.832,14	5,27%		1.502.122.003,24	2,77%	OK	OK	OK	1,92%	3,66%	7,11%	24,84%	1,92%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	24.126.295,82	3,05%		277.234.044,20	8,70%	OK	OK	OK	1,17%	2,94%	6,02%	13,31%	1,17%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	18.790.760,20	2,38%		2.377.873.918,41	0,79%	OK	OK	OK	1,89%	3,54%	7,01%	24,43%	1,89%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	61.298.458,04	7,76%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.000.864,94	1,52%		176.392.836,78	6,80%	OK	OK	OK	1,14%	2,34%	5,57%	13,28%	1,14%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.504.571,28	1,58%		7.240.763.781,97	0,17%	OK	OK	OK	1,09%	3,37%	7,02%	14,30%	1,09%
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	30.974.245,33	3,92%		1.288.512.627,24	2,40%	OK	OK	OK	2,12%	4,05%	7,96%	22,33%	2,12%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	5.818.776,49	0,74%		8.694.023.011,19	0,07%	OK	OK	OK	1,03%	3,11%	6,41%	13,18%	1,03%
FIDC	6.250.129,38	0,79%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	6.250.129,38	0,79%		358.170.573,68	1,75%	OK	OK	OK	1,25%	3,78%	7,86%	16,31%	1,25%
FIDC Fechado	169.817,77	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	54.990,90	0,01%		1.283.123,19	4,29%	OK	OK	OK	-88,00%	12,69%	795,34%	1683,13%	-88,00%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	114.826,87	0,01%		2.308.055,11	4,98%	OK	OK	OK	-1,57%	-7,55%	0,99%	-17,23%	-1,57%
Fundo Crédito Privado			1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	48.001.579,23	6,08%	15,00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.179.731,27	1,16%		39.522.940,33	23,23%	OK	OK	OK	5,12%	-0,97%	12,96%	53,59%	5,12%
GERAÇÃO FIA PROGRAMADO	8.665.063,81	1,10%		549.044.907,26	1,58%	OK	OK	OK	6,23%	0,43%	14,94%	21,28%	6,23%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	30.156.784,15	3,82%		515.341.765,80	5,85%	OK	OK	OK	7,26%	-0,76%	8,18%	44,02%	7,26%
Fundos de Índices de Ações	5.813.375,05	0,74%	2,00%			Art. 8o, Inciso II					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.813.375,05	0,74%		24.642.536,73	23,59%	OK	OK	OK	7,19%	-0,23%	12,64%	58,92%	7,19%
Fundos de Ações	50.623.304,19	6,41%	15,00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.756.816,16	2,25%		134.572.419,13	13,19%	OK	OK	OK	8,10%	-2,66%	14,19%	55,00%	8,10%
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.062.592,44	0,64%		118.880.421,53	4,26%	OK	OK	OK	7,44%	-2,00%	11,12%	39,89%	7,44%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	13.358.801,03	1,69%		159.796.859,06	8,36%	OK	OK	OK	10,64%	3,42%	9,47%	33,42%	10,64%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.862.497,79	0,74%		355.819.825,11	1,65%	OK	OK	OK	2,82%	-3,95%	3,24%	19,13%	2,82%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.274.232,70	0,41%		273.707.254,82	1,20%	OK	OK	OK	4,84%	-4,59%	8,10%	9,49%	4,84%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.308.364,07	0,67%		140.081.982,95	3,79%	OK	OK	OK	7,05%	3,73%	22,39%	73,43%	7,05%
Fundos Multimercados	5.598.255,50	0,71%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Enquadrado	
GERAÇÃO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.960.829,36	0,37%		132.789.906,81	2,23%	OK	OK	OK	1,71%	2,88%	7,06%	10,25%	1,71%
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.637.426,14	0,33%		147.349.747,59	1,79%	OK	OK	OK	2,03%	10,00%	11,21%	33,27%	2,03%
Fundos de Participações	7.767.555,42	0,98%	3,00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	502.758,82	0,06%		226.582.983,92	0,22%	OK	OK	OK	-0,09%	-0,28%	-6,35%	-2,69%	-0,09%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	886.795,07	0,11%		223.945.601,30	0,40%	OK	OK	OK	1,51%	0,37%	-1,25%	-16,77%	1,51%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.378.001,53	0,81%		45.283.810,83	14,08%	OK	OK	OK	0,12%	-15,15%	-11,12%	-28,96%	0,12%
Fundos de Investimento Imobiliários	12.591.726,82	1,59%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.870.200,00	0,62%		163.090.578,02	2,99%	OK	OK	OK	0,62%	-21,45%	-8,97%	-8,97%	0,62%
FII RB CAPITAL RENDA II	7.721.526,82	0,98%		132.619.714,26	5,82%	OK	OK	OK	10,77%	13,39%	14,39%	41,18%	10,77%
Disponibilidades Financeiras	11.191,24	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.