

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV**

**31/07/2017**

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	735.337.589,32		159,00%							3,04%	3,29%	7,41%	15,64%	9,05%
RV	150.350.932,72		41,00%							10,29%	6,82%	8,61%	18,90%	15,57%
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>885.703.815,73</b>		<b>200,00%</b>							<b>4,21%</b>	<b>3,89%</b>	<b>7,60%</b>	<b>16,40%</b>	<b>10,08%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										0,66%	1,72%	3,76%	8,15%	4,72%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										0,73%	1,82%	3,93%	8,82%	4,86%
<b>Títulos Públicos</b>	<b>160.564.469,83</b>	<b>18,13%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	160.564.469,83	18,13%								3,68%	3,36%	7,57%	15,45%	9,44%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>311.300.051,87</b>	<b>35,15%</b>	<b>50,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	33.592.167,38	3,79%		5.042.823.951,08	0,67%	OK	OK	OK		2,31%	3,92%	8,10%	17,68%	10,59%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	110.128.953,50	12,43%		2.749.245.325,68	4,01%	OK	OK	OK		2,31%	4,00%	8,14%	17,77%	10,63%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	89.364.526,13	10,09%		6.028.101.250,89	1,48%	OK	OK	OK		2,82%	3,44%	7,15%	13,53%	8,37%
GF FC FI RF IMA B	13.257.463,92	1,50%		102.368.625,76	12,95%	OK	OK	OK		4,01%	2,11%	6,90%	14,25%	8,93%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.548.941,21	0,74%		1.841.482.113,55	0,36%	OK	OK	OK		2,81%	3,37%	7,03%	13,29%	8,23%
SAFRA IMA FIC FI RF	9.337.369,28	1,05%		406.845.294,25	2,30%	OK	OK	OK		4,30%	2,64%	7,49%	14,25%	9,32%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	49.070.630,45	5,54%		1.335.400.262,97	3,67%	OK	OK	OK		2,82%	3,40%	7,12%	13,52%	8,34%
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa</b>	<b>187.337.488,43</b>	<b>21,15%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	43.098.851,49	4,87%		1.804.319.993,14	2,39%	OK	OK	OK		2,85%	3,47%	7,19%	13,59%	8,41%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	49.213.813,28	5,56%		1.170.018.377,76	4,21%	OK	OK	OK		4,01%	2,91%	7,66%	15,18%	9,69%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	44.858.219,53	5,06%		1.668.518.414,62	2,69%	OK	OK	OK		4,06%	2,98%	7,77%	15,43%	9,85%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	30.018.699,86	3,39%		275.619.939,41	10,89%	OK	OK	OK		2,93%	3,47%	7,36%	13,82%	8,62%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	20.147.904,27	2,27%		2.530.351.654,46	0,80%	OK	OK	OK		3,77%	2,89%	7,22%	14,74%	9,25%
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>69.382.329,73</b>	<b>7,83%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.731.063,17	1,44%		192.135.077,99	6,63%	OK	OK	OK		1,60%	1,45%	6,08%	12,00%	7,30%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.196.104,33	1,49%		9.674.874.982,91	0,14%	OK	OK	OK		0,81%	2,60%	5,53%	12,94%	6,68%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	33.015.715,95	3,73%		1.464.859.405,47	2,25%	OK	OK	OK		2,53%	2,37%	6,59%	15,08%	8,85%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	7.106.484,26	0,80%		7.964.082.161,14	0,09%	OK	OK	OK		0,80%	2,59%	5,37%	12,42%	6,50%
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	2.734.868,75	0,31%		6.203.106.318,52	0,04%	OK	OK	OK		0,80%	2,62%	5,45%	12,67%	6,60%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	598.093,27	0,07%		8.756.513.940,33	0,01%	OK	OK	OK		0,73%	2,41%	5,04%	11,78%	6,12%
<b>FIDC</b>	<b>6.636.868,92</b>	<b>0,75%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	6.636.868,92	0,75%		395.979.662,00	1,68%	OK	OK	OK		1,22%	3,73%	6,99%	15,40%	8,33%
<b>FIDC Fechado</b>	<b>116.380,54</b>	<b>0,01%</b>	<b>1,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	22.755,32	0,00%		530.958,42	4,29%	OK	OK	OK		-8,54%	-	-	-	-
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	93.625,22	0,01%		1.881.895,54	4,98%	OK	OK	OK		-3,79%	-10,66%	-18,46%	-17,66%	-19,74%
<b>Fundo Crédito Privado</b>			<b>1,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>49.137.457,32</b>	<b>5,55%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.527.107,18	1,08%		45.593.537,25	20,90%	OK	OK	OK		4,28%	3,66%	3,78%	17,24%	9,09%
GERACAO FIA PROGRAMADO	8.161.519,98	0,92%		411.119.680,03	1,99%	OK	OK	OK		2,74%	-3,19%	-5,81%	8,26%	0,06%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	31.448.830,16	3,55%		523.173.803,41	6,01%	OK	OK	OK		4,89%	1,48%	4,28%	12,81%	11,86%
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>5.919.832,39</b>	<b>0,67%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.919.832,39	0,67%		25.727.212,95	23,01%	OK	OK	OK		4,76%	0,69%	1,83%	14,70%	9,16%
<b>Fundos de Ações</b>	<b>51.863.658,50</b>	<b>5,86%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.715.432,34	2,00%		141.337.116,80	12,53%	OK	OK	OK		4,48%	-0,74%	-0,23%	13,92%	7,85%
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.054.990,78	0,57%		112.505.944,25	4,49%	OK	OK	OK		6,61%	0,70%	-0,15%	10,96%	7,28%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	14.674.086,00	1,66%		261.026.210,92	5,62%	OK	OK	OK		10,64%	4,77%	9,85%	20,25%	21,53%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.060.126,63	0,68%		367.814.976,56	1,65%	OK	OK	OK		1,73%	-1,76%	3,37%	6,72%	6,29%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.110.616,41	0,35%		174.311.290,07	1,78%	OK	OK	OK		1,87%	-3,32%	-5,00%	2,70%	-0,40%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.248.406,34	0,59%		154.028.552,79	3,41%	OK	OK	OK		5,08%	-4,94%	-1,13%	21,00%	5,84%
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>14.286.857,22</b>	<b>1,61%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.096.159,49	0,35%		117.318.679,49	2,64%	OK	OK	OK		1,27%	2,03%	4,57%	11,95%	6,36%
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	8.186.529,60	0,92%		33.247.543,91	24,62%	OK	OK	OK		2,04%	-	-	-	-
WA US INDEX 500 FI MULTI	3.004.168,13	0,34%		348.501.203,32	0,86%	OK	OK	OK		2,60%	6,05%	13,91%	26,67%	16,22%
<b>Fundos de Participações</b>	<b>15.908.757,50</b>	<b>1,80%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	499.396,68	0,06%		225.067.740,68	0,22%	OK	OK	OK		-0,11%	-0,32%	-0,67%	-6,97%	-0,76%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	737.990,15	0,08%		186.367.366,52	0,40%	OK	OK	OK		-0,66%	-1,96%	-7,46%	-8,61%	-6,05%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.671.370,67	1,66%		104.166.731,73	14,08%	OK	OK	OK		126,24%	126,09%	128,55%	103,14%	128,82%
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>13.234.369,79</b>	<b>1,49%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	4.100.000,00	0,46%		160.612.446,65	2,55%	OK	OK	OK		2,50%	-9,19%	-15,81%	-23,36%	-15,29%
FII RB CAPITAL RENDA II	9.134.369,79	1,03%		137.985.621,11	6,62%	OK	OK	OK		3,49%	13,93%	19,31%	36,48%	32,15%
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>15.293,69</b>	<b>0,002%</b>												

- 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.