

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

30/11/2017

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	773.638.376,74	82,56%	159,00%						-0,20%	1,19%	6,19%	14,99%	11,73%
RV	163.362.655,74	17,43%	41,00%						-3,78%	0,97%	17,41%	21,22%	22,67%
CONSOLIDADO	937.011.492,53	100,00%	200,00%						-0,84%	1,16%	8,00%	16,06%	13,49%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,64%	1,96%	3,34%	8,01%	7,31%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,74%	2,30%	4,05%	8,92%	8,04%
Fundos de Ações Referenciados	33.672.190,36	3,59%	15,00%			Art. 8º, Inciso I, Alínea A					Alocação:		
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	33.672.190,36	3,59%		570.219.018,90	5,91%	OK	OK	OK	-3,54%	0,36%	13,29%	17,97%	19,77%
Fundos de índices de Renda Variável			0,00%			Art. 8º, Inciso I, Alínea B					Alocação:		
Fundos de Ações	78.068.497,65	8,33%	15,00%			Art. 8º, Inciso II, Alínea A					Alocação:		
ARX INCOME FI EM ACOES	19.062.738,26	2,03%		159.907.033,98	11,92%	OK	OK	OK	-5,04%	-1,43%	12,42%	10,94%	16,05%
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.523.234,87	0,59%		169.275.976,10	3,26%	OK	OK	OK	-5,20%	1,14%	16,73%	15,14%	17,22%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	24.272.906,24	2,59%		370.058.188,76	6,56%	OK	OK	OK	-4,02%	1,76%	21,30%	37,18%	34,15%
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	10.161.200,00	1,08%		49.904.575,00	20,36%	OK	OK	Desenquadrado	-4,38%	-0,10%	13,17%	14,73%	16,36%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.486.063,11	0,69%		365.563.752,74	1,77%	OK	OK	OK	-3,11%	0,49%	8,74%	13,16%	13,76%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	8.501.837,95	0,91%		165.142.273,97	5,15%	OK	OK	OK	-5,99%	-0,28%	9,92%	11,27%	12,12%
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	4.060.517,22	0,43%		363.887.850,99	1,12%	OK	OK	OK	-1,71%	-2,80%	8,46%	18,23%	17,29%
Fundos de índices de Renda Variável	6.426.126,09	0,69%	2,00%			Art. 8º, Inciso II, Alínea B					Alocação:		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	6.426.126,09	0,69%		35.337.301,13	18,19%	OK	OK	Desenquadrado	-3,47%	1,15%	13,89%	15,31%	18,49%
Fundos Multimercados	15.102.207,56	1,61%	3,00%			Art. 8º, Inciso III					Alocação:		
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	8.474.973,60	0,90%		34.418.988,71	24,62%	OK	OK	Desenquadrado	0,08%	1,71%	-	-	-
WA US INDEX 500 FI MULTI	6.627.233,96	0,71%		725.497.719,97	0,91%	OK	OK	OK	3,31%	8,33%	13,62%	31,29%	27,27%
Fundos de Participação	15.950.666,71	1,70%	3,00%			Art. 8º, Inciso IV, Alínea A					Alocação:		
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	465.701,63	0,05%		209.882.072,37	0,22%	OK	OK	OK	-0,11%	-0,35%	-6,94%	-7,55%	-7,46%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	718.495,03	0,08%		183.847.498,42	0,39%	OK	OK	OK	-0,65%	-	-	-	-
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.766.470,05	1,58%		104.164.339,30	14,18%	OK	OK	Desenquadrado	0,06%	-	-	-	-
Fundos Imobiliários	14.142.967,37	1,51%	3,00%			Art. 8º, Inciso IV, Alínea B					Alocação:		
DOMO FII	5.520.200,00	0,59%		150.962.250,61	3,66%	OK	OK	OK	-21,14%	5,75%	34,64%	0,92%	14,05%
FII RB CAPITAL RENDA II	8.622.767,37	0,92%		135.472.486,56	6,36%	OK	OK	Desenquadrado	-5,21%	-2,67%	-2,01%	25,82%	23,46%
Disponibilidades Financeiras	10.460,05	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.