

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

29/09/2017

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	766.752.703,83	82,14%	159,00%							1,37%	5,76%	6,20%	15,60%	11,93%
RV	166.653.853,25	17,85%	41,00%							5,45%	22,26%	19,07%	29,63%	28,11%
CONSOLIDADO	933.413.978,22	100,00%	200,00%							2,08%	8,40%	8,32%	18,12%	14,52%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,44%	1,61%	3,20%	7,65%	5,72%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,62%	2,09%	3,77%	8,61%	6,28%
Títulos Públicos	165.061.451,13	17,68%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA SBCPREV	165.061.451,13	17,68%								1,52%	6,78%	6,02%	15,64%	12,72%
Fundos que contenham somente títulos públicos	340.676.422,08	36,50%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M FI	35.285.375,30	3,78%		4.989.933.175,82	0,71%	OK	OK	OK	1,45%	4,87%	7,06%	17,16%	13,36%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	147.717.461,84	15,83%		3.093.607.731,13	4,77%	OK	OK	OK	1,44%	4,83%	7,06%	17,22%	13,36%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	91.369.663,14	9,79%		6.273.482.056,63	1,46%	OK	OK	OK	0,99%	5,13%	6,49%	13,27%	10,80%	
GF FC FI RF IMA B	13.661.935,11	1,46%		85.945.174,35	15,90%	OK	OK	OK	1,78%	7,18%	4,95%	14,94%	12,25%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.693.110,66	0,72%		1.877.355.547,88	0,36%	OK	OK	OK	0,97%	5,07%	6,37%	13,01%	10,61%	
SAFRA IMA FIC FI RF	12.189.588,70	1,31%		407.543.449,80	2,99%	OK	OK	OK	1,81%	7,68%	5,68%	15,23%	12,86%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	33.759.287,33	3,62%		1.302.582.730,64	2,59%	OK	OK	OK	0,99%	5,13%	6,45%	13,24%	10,77%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa	181.693.919,32	19,47%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B 5 LP FC	28.933.298,50	3,10%		1.993.423.540,77	1,45%	OK	OK	OK	0,99%	5,16%	6,53%	13,28%	10,84%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B FI	50.788.715,72	5,44%		1.309.486.949,77	3,88%	OK	OK	OK	1,84%	7,34%	5,84%	15,81%	13,20%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	46.311.649,86	4,96%		1.698.626.671,43	2,73%	OK	OK	OK	1,83%	7,43%	5,91%	16,15%	13,41%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	34.873.184,09	3,74%		303.020.808,14	11,51%	OK	OK	OK	1,02%	5,36%	6,61%	13,68%	11,18%	
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	20.787.071,15	2,23%		2.698.829.713,03	0,77%	OK	OK	OK	1,79%	7,07%	5,60%	15,50%	12,71%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	72.447.180,54	7,76%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	15.651.219,49	1,68%		201.163.071,04	7,78%	OK	OK	OK	1,47%	4,28%	4,95%	12,42%	10,13%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.415.498,24	1,44%		11.514.086.382,12	0,12%	OK	OK	OK	0,67%	2,49%	5,25%	12,20%	8,46%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	33.909.241,02	3,63%		1.524.890.880,87	2,22%	OK	OK	OK	1,51%	5,30%	5,36%	15,04%	11,79%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	7.208.037,88	0,77%		7.596.415.591,82	0,09%	OK	OK	OK	0,63%	2,24%	4,87%	11,46%	8,02%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	1.671.297,70	0,18%		6.857.988.274,06	0,02%	OK	OK	OK	0,65%	2,31%	4,98%	11,74%	8,20%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	591.886,21	0,06%		8.834.792.916,47	0,01%	OK	OK	OK	0,59%	2,10%	4,57%	10,86%	7,56%	
FIDC	6.747.501,85	0,72%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	6.747.501,85	0,72%		402.580.423,49	1,68%	OK	OK	OK	0,93%	3,44%	6,96%	14,84%	10,71%	
FIDC Fechado	126.228,91	0,01%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	37.097,92	0,00%		865.619,72	4,29%	OK	OK	OK	-42,75%	49,10%	14,04%	-11,50%	-91,90%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	89.130,99	0,01%		1.791.560,17	4,98%	OK	OK	OK	9,96%	-8,40%	-17,54%	-29,99%	-23,59%	
Fundo Crédito Privado			1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	54.418.237,03	5,83%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	10.627.897,11	1,14%		50.945.872,06	20,86%	OK	OK	OK	4,49%	16,32%	16,82%	25,92%	21,70%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	8.582.889,53	0,92%		355.309.632,58	2,42%	OK	OK	OK	3,49%	8,04%	0,53%	11,86%	5,23%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	35.207.450,39	3,77%		584.223.476,25	6,03%	OK	OK	OK	4,93%	17,43%	14,95%	26,65%	25,23%	
Fundos de Índices de Ações	6.656.847,07	0,71%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	6.656.847,07	0,71%		30.307.966,27	21,96%	OK	OK	OK	4,78%	17,80%	14,02%	26,72%	22,75%	
Fundos de Ações	58.683.987,30	6,29%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	20.159.636,91	2,16%		161.346.452,22	12,49%	OK	OK	OK	4,24%	18,90%	13,21%	25,12%	22,73%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	5.810.955,66	0,62%		136.413.592,47	4,26%	OK	OK	OK	6,41%	22,55%	16,97%	25,71%	23,33%	
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	16.844.642,34	1,80%		336.785.860,02	5,00%	OK	OK	OK	5,82%	22,00%	22,37%	42,82%	39,50%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.741.497,87	0,72%		421.402.170,14	1,60%	OK	OK	OK	4,45%	13,17%	11,26%	17,68%	18,24%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.214.148,40	0,34%		109.235.244,97	2,94%	OK	OK	OK	2,04%	5,27%	-1,50%	3,46%	2,92%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.913.106,12	0,63%		170.445.183,85	3,47%	OK	OK	OK	6,05%	18,39%	6,61%	35,71%	19,25%	
Fundos Multimercados	14.678.926,03	1,57%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.168.420,54	0,34%		102.312.263,45	3,10%	OK	OK	OK	1,33%	3,63%	5,19%	12,64%	8,84%	
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	8.411.344,00	0,90%		34.160.573,75	24,62%	OK	OK	OK	0,95%	4,84%	-	-	-	
WA US INDEX 500 FI MULTI	3.099.161,49	0,33%		467.829.534,58	0,66%	OK	OK	OK	2,06%	5,85%	11,15%	28,22%	19,90%	
Fundos de Participações	15.878.301,78	1,70%	3,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	466.784,65	0,05%		210.370.171,91	0,22%	OK	OK	OK	-0,12%	-6,64%	-6,91%	-7,50%	-7,24%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	728.012,09	0,08%		183.847.498,42	0,40%	OK	OK	OK	-0,61%	-2,00%	-3,78%	-8,85%	-7,32%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.683.505,04	1,57%		104.252.885,67	14,08%	OK	OK	OK	0,09%	126,42%	126,95%	102,48%	129,01%	
Fundos de Investimento Imobiliários	16.337.554,04	1,75%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	7.500.000,00	0,80%		160.569.648,30	4,67%	OK	OK	OK	43,68%	87,50%	51,73%	20,97%	54,96%	
FII RB CAPITAL RENDA II	8.837.554,04	0,95%		151.587.547,86	5,83%	OK	OK	OK	-0,69%	-1,35%	13,14%	28,04%	25,97%	
Disponibilidades Financeiras	7.421,14	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.