



SBCPREV

29/12/2017

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	588.548.324,12	79,67%	159,00%						0,92%	0,69%	6,55%	12,68%	12,68%
RV	150.221.215,19	19,41%	41,00%						4,87%	0,17%	23,48%	29,34%	29,34%
CONSOLIDADO	738.769.656,17	100,00%	200,00%						1,70%	0,59%	9,67%	15,79%	15,79%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,72%	2,24%	3,89%	8,11%	8,11%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,91%	2,58%	4,73%	9,05%	9,05%
Títulos Públicos	119.978.705,96	16,24%	40,00%			Art. 7º, Inciso I, Alínea A					Alocação:		
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	119.978.705,96	16,24%							0,90%	-0,13%	6,69%	12,54%	12,54%
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham somente títulos públicos	251.925.551,53	34,10%	50,00%			Art. 7º, Inciso I, Alínea B					Alocação:		
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	28.870.446,70	3,91%		4.707.912.251,54	0,61%	OK	OK	OK	1,22%	1,37%	6,31%	14,91%	14,91%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	103.509.279,99	14,01%		2.638.455.038,83	3,92%	OK	OK	OK	1,19%	1,27%	6,17%	14,80%	14,80%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	51.498.418,93	6,97%		6.666.405.048,53	0,77%	OK	OK	OK	0,87%	1,42%	6,63%	12,38%	12,38%
GF FC FI RF IMA B	13.600.010,52	1,84%		65.985.981,50	20,61%	OK	OK	Desenquadrado	0,81%	-0,45%	6,69%	11,75%	11,75%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.785.380,11	0,92%		1.738.380.542,12	0,39%	OK	OK	OK	0,85%	1,38%	6,52%	12,14%	12,14%
SAFRA IMA FIC FI RF	12.132.978,98	1,64%		350.442.768,39	3,46%	OK	OK	OK	0,84%	-0,46%	7,18%	12,34%	12,34%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	35.529.036,30	4,81%		1.269.069.386,21	2,80%	OK	OK	OK	0,87%	1,45%	6,66%	12,38%	12,38%
Fundos de Índice Renda fixa que contenham somente títulos públicos			0,00%			Art. 7º, Inciso I, Alínea C					Alocação:		
Operações Compromissadas			0,00%			Art. 7º, Inciso II					Alocação:		
Fundos Referenciados Renda Fixa - IMA e IDkA			35,00%			Art. 7º, Inciso III, Alínea A					Alocação:		
Fundos Índice Renda Fixa - IMA e IDkA			0,00%			Art. 7º, Inciso III, Alínea B					Alocação:		
Fundos Renda Fixa - DI	209.588.217,08	28,37%	30,00%			Art. 7º, Inciso IV, Alínea A					Alocação:		
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	15.895.928,05	2,15%		213.504.727,15	7,45%	OK	OK	OK	0,64%	1,56%	5,91%	11,85%	11,85%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	19.322.412,68	2,62%		2.141.105.909,20	0,90%	OK	OK	OK	0,87%	1,42%	6,65%	12,42%	12,42%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	50.606.951,21	6,85%		1.070.534.298,25	4,73%	OK	OK	OK	0,85%	-0,36%	6,95%	12,80%	12,80%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.650.001,05	1,85%		9.371.259.094,82	0,15%	OK	OK	OK	0,53%	1,75%	4,28%	10,35%	10,35%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	46.130.886,56	6,24%		1.455.106.344,45	3,17%	OK	OK	OK	0,85%	-0,39%	7,01%	12,96%	12,96%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	26.864.616,16	3,64%		323.458.894,79	8,31%	OK	OK	OK	0,87%	1,33%	6,76%	12,66%	12,66%
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	25.937.641,77	3,51%		1.451.065.616,52	1,79%	OK	OK	OK	0,80%	0,97%	6,32%	12,87%	12,87%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.278.097,33	0,85%		8.702.401.390,30	0,07%	OK	OK	OK	0,53%	1,74%	4,02%	9,89%	9,89%
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	4.213.058,94	0,57%		6.666.050.136,27	0,06%	OK	OK	OK	0,53%	1,75%	4,10%	10,10%	10,10%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	688.623,33	0,09%		8.501.152.466,41	0,01%	OK	OK	OK	0,47%	1,56%	3,69%	9,23%	9,23%
Fundos de Índice Renda Fixa - DI			0,00%			Art. 7º, Inciso IV, Alínea B					Alocação:		
Letras Imobiliárias Garantidas			0,00%			Art. 7º, Inciso V					Alocação:		
Certificado de Depósito Bancário (CDB)			0,00%			Art. 7º, Inciso VI, Alínea A					Alocação:		
Depósito Poupança			0,00%			Art. 7º, Inciso VI, Alínea B					Alocação:		
FIDC Cota Sênior	7.055.849,55	0,96%	3,00%			Art. 7º, Inciso VII, Alínea A					Alocação:		
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIO	6.884.491,43	0,93%		403.861.018,29	1,70%	OK	OK	OK	0,59%	2,41%	5,93%	13,37%	13,37%
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	91.854,05	0,01%		2.143.264,92	4,29%	OK	OK	OK	143,59%	147,60%	269,17%	-79,95%	-79,95%
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	79.504,07	0,01%		1.598.806,27	4,97%	OK	OK	OK	-3,84%	-10,76%	-18,26%	-31,82%	-31,82%
Fundos Crédito Privado			1,00%			Art. 7º, Inciso VII, Alínea B					Alocação:		
Fundos Lei nº12.431			0,00%			Art. 7º, Inciso VII, Alínea C					Alocação:		

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

29/12/2017

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	588.548.324,12	79,67%	159,00%						0,92%	0,69%	6,55%	12,68%	12,68%
RV	150.221.215,19	19,41%	41,00%						4,87%	0,17%	23,48%	29,34%	29,34%
CONSOLIDADO	738.769.656,17	100,00%	200,00%						1,70%	0,59%	9,67%	15,79%	15,79%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,72%	2,24%	3,89%	8,11%	8,11%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,91%	2,58%	4,73%	9,05%	9,05%
Fundos de Ações Referenciados	87.943.958,44	11,90%	15,00%			Art. 8º, Inciso I, Alínea A					Alocação:		
ARX INCOME FI EM ACOES	20.255.545,42	2,74%		166.276.343,32	12,18%	OK	OK	OK	6,26%	0,48%	19,46%	23,31%	23,31%
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.399.564,59	0,32%		183.863.771,81	1,31%	OK	OK	OK	6,25%	0,99%	23,76%	24,54%	24,54%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	18.900.308,29	2,56%		424.192.021,43	4,46%	OK	OK	OK	5,02%	0,99%	28,26%	40,89%	40,89%
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	10.766.794,02	1,46%		55.210.030,37	19,50%	OK	OK	Desenquadrado	5,96%	1,31%	17,84%	23,29%	23,29%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	35.621.746,12	4,82%		605.134.812,81	5,89%	OK	OK	OK	5,79%	1,18%	18,81%	26,70%	26,70%
Fundos de índices de Renda Variável	6.823.912,58	0,92%	0,00%			Art. 8º, Inciso I, Alínea B					Alocação:		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	6.823.912,58	0,92%		37.698.057,78	18,10%	OK	OK	Desenquadrado	6,19%	2,51%	20,76%	25,83%	25,83%
Fundos de Ações	15.779.493,50	2,14%	15,00%			Art. 8º, Inciso II, Alínea A					Alocação:		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.825.497,57	0,92%		382.439.702,61	1,78%	OK	OK	OK	5,23%	1,25%	14,58%	19,71%	19,71%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	8.953.995,93	1,21%		172.183.048,90	5,20%	OK	OK	OK	5,32%	-0,97%	17,24%	18,09%	18,09%
Fundos de índices de Renda Variável			2,00%			Art. 8º, Inciso II, Alínea B					Alocação:		
Fundos Multimercados	8.736.494,29	1,18%	3,00%			Art. 8º, Inciso III					Alocação:		
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	5.341.804,50	0,72%		34.711.047,05	15,39%	OK	OK	Desenquadrado	0,85%	1,61%	6,53%	-	-
WA US INDEX 500 FI MULTI	3.394.689,79	0,46%		946.407.676,08	0,36%	OK	OK	OK	1,71%	7,96%	14,28%	29,44%	29,44%
Fundos de Participação	16.009.100,70	2,17%	3,00%			Art. 8º, Inciso IV, Alínea A					Alocação:		
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	465.167,44	0,06%		209.641.323,51	0,22%	OK	OK	OK	-0,11%	-0,35%	-6,96%	-7,56%	-7,56%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	744.863,49	0,10%		183.847.498,42	0,41%	OK	OK	OK	3,67%	-	-	-	-
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.799.069,77	2,00%		104.164.339,30	14,21%	OK	OK	Desenquadrado	0,22%	-	-	-	-
Fundos Imobiliários	14.928.255,68	2,02%	3,00%			Art. 8º, Inciso IV, Alínea B					Alocação:		
DOMO FII	6.190.000,00	0,84%		153.397.209,24	4,04%	OK	OK	OK	12,13%	-17,47%	54,75%	27,89%	27,89%
FII RB CAPITAL RENDA II	8.738.255,68	1,18%		136.935.653,76	6,38%	OK	OK	Desenquadrado	0,19%	-1,81%	-3,13%	23,69%	23,69%
Disponibilidades Financeiras	116,86	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.