

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

31/08/2015

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		
CONSOLIDADO	469.954.788,08	100,00%	161,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										-1,94%	-0,87%	2,65%	3,09%	5,29%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,74%	3,10%	8,00%	16,47%	11,96%	
										0,71%	3,13%	7,57%	16,10%	11,31%	
Títulos Públicos	61.011.822,16	12,98%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	61.011.822,16	12,98%								-2,58%	-2,75%	2,73%	8,93%	5,69%	
Fundos que contenham somente títulos públicos	132.193.947,54	28,13%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	50.496.556,94	10,74%		3.859.928.140,21	1,31%	OK	OK	OK	-0,51%	2,02%	5,21%	10,74%	8,53%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	27.138.754,50	5,77%		1.694.384.289,47	1,60%	OK	OK	OK	-0,50%	2,05%	5,14%	10,60%	8,53%		
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	54.558.636,10	11,61%		918.972.334,85	5,94%	OK	OK	OK	-0,48%	2,11%	5,27%	10,89%	8,70%		
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	127.909.049,75	27,22%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	33.931.540,20	7,22%		1.172.057.752,08	2,90%	OK	OK	OK	-3,06%	-4,07%	0,50%	2,71%	4,11%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	59.661.948,97	12,70%		1.132.510.124,47	5,27%	OK	OK	OK	-0,52%	2,03%	5,18%	10,61%	8,49%		
BRADESCO FI RF IMA B	28.902.646,05	6,15%		1.038.086.029,93	2,78%	OK	OK	OK	-3,23%	-4,21%	0,44%	2,96%	4,14%		
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.412.914,53	1,15%		140.521.057,66	3,85%	OK	OK	OK	-0,76%	1,79%	4,99%	10,36%	8,21%		
Fundos de Renda Fixa (Normal)	21.013.396,67	4,47%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.357.929,47	2,20%		6.035.060.462,88	0,17%	OK	OK	OK	1,11%	3,41%	6,55%	12,55%	8,45%		
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.485.210,73	1,59%		135.152.789,50	5,54%	OK	OK	OK	0,47%	2,37%	5,24%	9,22%	7,09%		
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	3.170.256,47	0,67%		4.289.575.593,61	0,07%	OK	OK	OK	1,05%	3,23%	6,15%	11,64%	7,90%		
FIDC	5.046.891,37	1,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado		
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	5.046.891,37	1,07%		272.148.320,85	1,85%	OK	OK	OK	1,27%	3,90%	7,49%	14,32%	9,66%		
FIDC Fechado	389.534,33	0,08%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	226.736,99	0,05%		5.290.539,14	4,29%	OK	OK	OK	-3,41%	-8,58%	-10,78%	183,23%	-10,26%		
FIDC TRENDBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	162.797,34	0,03%		3.354.580,69	4,85%	OK	OK	OK	-1,35%	-	0,93%	-	-		
Fundo Crédito Privado	25.537.135,51	5,43%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.244.586,51	1,97%		93.414.684,21	9,90%	OK	OK	OK	0,84%	3,36%	7,82%	15,23%	10,93%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.691.635,00	1,85%		96.085.182,30	9,05%	OK	OK	OK	1,02%	3,44%	8,18%	15,61%	11,21%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.600.914,00	1,62%		88.264.482,19	8,61%	OK	OK	OK	0,94%	3,34%	8,01%	15,73%	11,06%		
Fundos de Ações Referenciados	41.396.387,55	8,81%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado		
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.828.102,11	1,45%		57.694.244,42	11,83%	OK	OK	OK	-7,66%	-10,52%	-8,06%	-22,21%	-5,19%		
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.611.464,00	0,98%		24.327.847,49	18,96%	OK	OK	OK	-5,85%	-6,21%	-3,47%	-14,25%	-1,89%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.259.798,53	0,91%		24.636.957,81	17,29%	OK	OK	OK	-7,12%	-10,50%	-8,40%	-22,84%	-6,93%		
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.098.073,38	0,66%		506.320.798,89	0,61%	OK	OK	OK	-6,57%	-2,89%	2,89%	-16,40%	-2,62%		
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	22.598.949,53	4,81%		460.569.970,98	4,91%	OK	OK	OK	-6,67%	-7,99%	-6,13%	-18,56%	-5,44%		
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:			
Fundos de Ações	33.991.136,70	7,23%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado		
ARX INCOME FI EM ACOES	11.211.739,76	2,39%		133.973.477,11	8,37%	OK	OK	OK	-5,59%	-6,38%	-5,03%	-18,47%	-3,42%		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.604.899,53	1,41%		1.492.780.466,95	0,44%	OK	OK	OK	-5,47%	-2,66%	2,47%	-2,10%	6,44%		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.807.754,21	1,02%		291.803.057,73	1,65%	OK	OK	OK	-7,33%	-8,67%	-8,02%	-12,24%	-8,30%		
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.654.352,20	0,78%		103.304.773,50	3,54%	OK	OK	OK	-9,96%	-11,61%	-15,82%	-36,83%	-15,09%		
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	7.712.391,00	1,64%		102.774.587,05	7,50%	OK	OK	OK	-3,09%	-3,66%	-0,92%	-18,55%	-8,28%		
Fundos Multimercados	2.554.750,51	0,54%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado		
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.554.750,51	0,54%		217.717.529,60	1,17%	OK	OK	OK	0,59%	4,08%	8,71%	13,71%	9,63%		
Fundos de Participações	5.776.551,11	1,23%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado		
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	379.314,99	0,08%		171.334.934,81	0,22%	OK	OK	OK	7,83%	6,35%	4,33%	2,30%	2,66%		
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	942.717,48	0,20%		238.067.870,20	0,40%	OK	OK	OK	-0,54%	2,28%	-13,68%	-15,08%	-18,82%		
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.454.518,64	0,95%		31.627.082,34	14,08%	OK	OK	OK	-0,30%	-0,93%	-1,93%	-3,41%	-2,36%		
Fundos de Investimento Imobiliários	13.126.114,35	2,79%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado		
DOMO FII	5.900.000,00	1,26%		191.185.854,91	3,09%	OK	OK	OK	-4,07%	-6,35%	-10,60%	-18,62%	-10,61%		
FII RB CAPITAL RENDA II	7.226.114,35	1,54%		127.229.687,45	5,68%	OK	OK	OK	-0,94%	0,05%	-2,74%	-9,91%	0,76%		
Disponibilidades Financeiras	8.070,53	0,002%													

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.