

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

31/12/2015

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	496.531.322,92	100,00%	161,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,81%	4,34%	2,75%	9,35%	9,35%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,39%	4,31%	7,27%	17,95%	17,95%	
										1,45%	4,32%	7,32%	17,31%	17,31%	
Títulos Públicos	82.916.293,75	16,70%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A							Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	82.916.293,75	16,70%								1,54%	5,20%	2,60%	11,42%	11,42%	
Fundos que contenham somente títulos públicos	136.918.925,73	27,58%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B							Alocação:	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	63.450.967,25	12,78%		3.791.382.507,35	1,67%	OK	OK	OK	2,04%	5,10%	7,14%	14,86%	14,86%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	23.436.214,06	4,72%		1.649.982.018,06	1,42%	OK	OK	OK	2,08%	5,12%	7,21%	14,94%	14,94%		
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	50.031.744,42	10,08%		1.045.233.374,35	4,79%	OK	OK	OK	2,10%	5,17%	7,37%	15,24%	15,24%		
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	132.051.115,94	26,59%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A							Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	35.403.527,29	7,13%		901.755.196,20	3,93%	OK	OK	OK	1,50%	5,04%	0,39%	8,62%	8,62%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	60.771.403,78	12,24%		1.193.004.322,28	5,09%	OK	OK	OK	2,07%	5,10%	7,17%	14,87%	14,87%		
BRADESCO FI RF IMA B	30.150.861,71	6,07%		1.023.375.388,84	2,95%	OK	OK	OK	1,43%	5,06%	0,19%	8,64%	8,64%		
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.725.323,16	1,15%		132.299.190,18	4,33%	OK	OK	OK	2,13%	5,17%	6,83%	14,45%	14,45%		
Fundos de Renda Fixa (Normal)	25.811.523,42	5,20%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A							Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.826.155,64	2,18%		6.619.747.173,44	0,16%	OK	OK	OK	1,16%	3,36%	6,93%	13,35%	13,35%		
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.778.584,75	1,57%		127.921.111,73	6,08%	OK	OK	OK	1,28%	3,27%	5,20%	11,28%	11,28%		
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	7.206.783,03	1,45%		5.554.565.548,15	0,13%	OK	OK	OK	1,10%	3,17%	6,53%	12,48%	12,48%		
FIDC	5.309.268,48	1,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI							Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	5.309.268,48	1,07%		280.503.311,75	1,89%	OK	OK	OK	1,34%	3,87%	7,98%	15,36%	15,36%		
FIDC Fechado	357.092,24	0,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A							Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	213.052,22	0,04%		4.971.227,16	4,29%	OK	OK	OK	0,09%	-	-	-10,05%	-10,05%		
FIDC TRENDBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	144.040,02	0,03%		2.895.248,33	4,98%	OK	OK	OK	-3,36%	-11,17%	-13,68%	-12,34%	-12,34%		
Fundo Crédito Privado	17.049.147,50	3,43%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B							Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.088.985,00	1,83%		100.477.815,34	9,05%	OK	OK	OK	1,48%	3,80%	6,90%	16,30%	16,30%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.960.162,50	1,60%		92.436.217,27	8,61%	OK	OK	OK	1,51%	3,92%	6,88%	16,31%	16,31%		
Fundos de Ações Referenciados	39.755.877,31	8,01%	15,00%			Art. 8o, Inciso I							Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.440.818,85	1,30%		36.647.516,29	17,58%	OK	OK	OK	-1,81%	-2,92%	-16,59%	-10,57%	-10,57%		
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.489.874,23	0,90%		8.952.476,40	50,15%	OK	OK	OK	-1,40%	-0,75%	-9,64%	-4,48%	-4,48%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	3.920.054,71	0,79%		17.361.682,70	22,58%	OK	OK	OK	-4,03%	-3,73%	-17,98%	-14,35%	-14,35%		
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.203.183,09	0,65%		501.729.173,51	0,64%	OK	OK	OK	-1,14%	1,00%	-0,94%	0,69%	0,69%		
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	21.701.946,43	4,37%		422.194.003,62	5,14%	OK	OK	OK	-2,14%	-2,34%	-12,20%	-9,20%	-9,20%		
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II							Alocação:		
Fundos de Ações	33.327.121,31	6,71%	15,00%			Art. 8o, Inciso III							Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	10.923.295,79	2,20%		112.353.695,94	9,72%	OK	OK	OK	-2,87%	-3,42%	-10,17%	-5,91%	-5,91%		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.131.380,01	1,23%		939.279.255,50	0,65%	OK	OK	OK	-2,14%	-5,78%	-11,72%	-1,18%	-1,18%		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.073.773,43	1,02%		307.949.066,22	1,65%	OK	OK	OK	0,11%	6,48%	-3,27%	-3,22%	-3,22%		
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.333.806,27	0,67%		81.320.748,70	4,10%	OK	OK	OK	-2,31%	-3,58%	-18,41%	-22,53%	-22,53%		
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	7.864.865,81	1,58%		93.313.248,81	8,43%	OK	OK	OK	-4,12%	0,60%	-0,67%	-6,47%	-6,47%		
Fundos Multimercados	2.663.906,54	0,54%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV							Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.663.906,54	0,54%		206.117.878,11	1,29%	OK	OK	OK	1,38%	2,32%	7,35%	14,32%	14,32%		
Fundos de Participações	8.125.872,47	1,64%	5,00%			Art. 8o, Inciso V							Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	372.909,85	0,08%		168.441.754,93	0,22%	OK	OK	OK	-0,46%	-1,28%	5,24%	0,93%	0,93%		
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.789.383,25	0,36%		451.878.928,00	0,40%	OK	OK	OK	149,87%	90,84%	95,25%	54,08%	54,08%		
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.963.579,37	1,20%		42.341.413,55	14,08%	OK	OK	OK	0,62%	-	-	-0,94%	-0,94%		
Fundos de Investimento Imobiliários	12.163.001,17	2,45%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI							Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.850.000,00	1,18%		170.705.027,86	3,43%	OK	OK	OK	21,88%	12,50%	-7,14%	-11,37%	-11,37%		
FII RB CAPITAL RENDA II	6.313.001,17	1,27%		125.449.156,65	5,03%	OK	OK	OK	-7,12%	-6,71%	-11,04%	-9,86%	-9,86%		
Disponibilidades Financeiras	82.177,06	0,02%													

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.