

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

30/06/2015

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	473.830.884,13	100,00%	161,00%							0,59%	3,49%	6,84%	10,51%	6,84%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,26%	3,99%	9,96%	15,87%	9,96%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,28%	3,76%	9,31%	15,43%	9,31%
Títulos Públicos	42.867.160,54	9,05%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA FFIN2	42.867.160,54	9,05%								-0,08%	3,86%	8,59%	13,92%	8,59%
Fundos que contenham somente títulos públicos	130.309.909,39	27,50%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	49.627.632,61	10,47%		3.884.284.280,37	1,28%	OK	OK	OK	OK	0,77%	2,92%	7,20%	11,78%	7,20%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	26.810.693,81	5,66%		1.733.343.475,53	1,55%	OK	OK	OK	OK	0,81%	2,86%	7,21%	11,61%	7,21%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	53.871.582,97	11,37%		810.168.894,04	6,65%	OK	OK	OK	OK	0,83%	2,91%	7,33%	11,88%	7,33%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	128.760.839,86	27,17%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	35.267.010,61	7,44%		1.439.833.804,14	2,45%	OK	OK	OK	OK	-0,29%	4,82%	8,21%	13,16%	8,21%
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	58.042.357,62	12,25%		838.085.805,37	6,93%	OK	OK	OK	OK	0,80%	2,91%	7,18%	11,65%	7,18%
BRADESCO FI RF IMA B	30.092.435,51	6,35%		1.060.209.893,98	2,84%	OK	OK	OK	OK	-0,26%	4,95%	8,43%	13,55%	8,43%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.359.036,12	1,13%		66.662.140,37	8,04%	OK	OK	OK	OK	0,78%	2,99%	7,13%	-	7,13%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	22.172.568,96	4,68%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.124.585,37	2,14%		5.832.199.246,04	0,17%	OK	OK	OK	OK	1,08%	3,06%	6,01%	12,04%	6,01%
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.394.009,33	1,56%		157.527.811,02	4,69%	OK	OK	OK	OK	1,12%	3,20%	5,78%	9,65%	5,78%
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	4.653.974,26	0,98%		4.002.463.169,91	0,12%	OK	OK	OK	OK	1,01%	2,86%	5,59%	11,09%	5,59%
FIDC	4.916.844,49	1,04%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	4.916.844,49	1,04%		272.364.228,38	1,81%	OK	OK	OK	OK	1,22%	3,49%	6,83%	13,69%	6,83%
FIDC Fechado	405.636,73	0,09%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	238.774,74	0,05%		5.571.420,50	4,29%	OK	OK	OK	OK	-3,72%	-3,61%	-5,50%	170,51%	-5,50%
FIDC TRENDBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	166.861,99	0,04%		3.353.976,94	4,98%	OK	OK	OK	OK	-1,33%	2,48%	1,55%	27,23%	1,55%
Fundo Crédito Privado	25.012.240,92	5,28%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.062.007,42	1,91%		91.569.769,01	9,90%	OK	OK	OK	OK	1,32%	3,63%	8,74%	14,42%	8,74%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.502.720,00	1,79%		93.996.741,61	9,05%	OK	OK	OK	OK	1,20%	3,94%	8,80%	15,05%	8,80%
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.447.513,50	1,57%		86.483.125,67	8,61%	OK	OK	OK	OK	1,25%	3,89%	8,82%	15,09%	8,82%
Fundos de Ações Referenciados	45.402.169,00	9,58%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.721.505,08	1,63%		66.293.197,06	11,65%	OK	OK	OK	OK	1,19%	4,44%	7,22%	0,98%	7,22%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.969.312,84	1,05%		27.440.682,71	18,11%	OK	OK	OK	OK	1,07%	2,67%	5,72%	1,06%	5,72%
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.779.224,00	1,01%		26.502.964,83	18,03%	OK	OK	OK	OK	0,42%	3,26%	4,42%	-0,43%	4,42%
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.214.681,23	0,68%		540.164.909,38	0,60%	OK	OK	OK	OK	1,37%	3,90%	1,65%	-9,96%	1,65%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	24.717.445,85	5,22%		486.150.926,00	5,08%	OK	OK	OK	OK	0,64%	1,57%	3,42%	-0,80%	3,42%
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	36.354.488,00	7,67%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	12.159.393,88	2,57%		156.684.055,40	7,76%	OK	OK	OK	OK	1,54%	1,64%	4,74%	1,18%	4,74%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.945.814,99	1,47%		1.434.583.419,43	0,48%	OK	OK	OK	OK	2,37%	6,28%	11,93%	11,89%	11,93%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.245.183,26	1,11%		318.352.569,76	1,65%	OK	OK	OK	OK	-0,37%	1,20%	0,05%	-0,48%	0,05%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.085.832,76	0,86%		131.763.981,79	3,10%	OK	OK	OK	OK	-1,18%	-0,96%	-5,06%	-18,19%	-5,06%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	7.918.263,11	1,67%		149.644.787,06	5,29%	OK	OK	OK	OK	0,68%	-1,84%	-5,83%	-11,80%	-5,83%
Fundos Multimercados	2.481.404,02	0,52%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.481.404,02	0,52%		218.493.802,03	1,14%	OK	OK	OK	OK	1,09%	2,65%	6,49%	12,63%	6,49%
Fundos de Participações	5.558.117,61	1,17%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	231.090,32	0,05%		104.497.421,45	0,22%	OK	OK	OK	OK	-0,66%	-1,89%	-4,10%	-6,27%	-4,10%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	916.450,91	0,19%		231.434.489,30	0,40%	OK	OK	OK	OK	-0,57%	-15,68%	-21,09%	-16,67%	-21,09%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.410.576,38	0,93%		31.315.092,24	14,08%	OK	OK	OK	OK	-0,48%	-1,02%	-1,92%	-3,50%	-1,92%
Fundos de Investimento Imobiliários	13.531.511,00	2,86%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	6.300.000,00	1,33%		191.122.163,97	3,30%	OK	OK	OK	OK	0,03%	3,28%	-4,55%	-18,18%	-4,55%
FII RB CAPITAL RENDA II	7.231.511,00	1,53%		127.701.048,43	5,66%	OK	OK	OK	OK	0,62%	0,75%	1,33%	-5,63%	1,33%
Disponibilidades Financeiras	16.057.993,61	3,39%												

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.