

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

29/05/2015

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	469.335.754,65	100,00%	161,00%							0,71%	3,55%	4,13%	10,91%	6,21%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,48%	4,76%	9,80%	15,29%	8,59%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,23%	4,30%	9,30%	14,98%	7,93%
Títulos Públicos	42.902.026,97	9,14%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA SBCPREV FFIN2	42.902.026,97	9,14%								1,87%	5,63%	9,34%	14,90%	8,68%
Fundos que contenham somente títulos públicos	134.161.581,61	28,59%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	53.430.609,77	11,38%		749.651.169,80	7,13%	OK	OK	OK	1,63%	3,09%	6,48%	12,17%	6,45%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	54.136.328,13	11,53%		3.699.023.811,03	1,46%	OK	OK	OK	1,69%	3,13%	6,44%	12,11%	6,39%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	26.594.643,71	5,67%		1.733.820.412,27	1,53%	OK	OK	OK	1,59%	3,04%	6,36%	11,89%	6,35%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	138.017.297,92	29,41%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	45.398.805,29	9,67%		1.376.084.297,02	3,30%	OK	OK	OK	2,58%	4,76%	6,44%	13,47%	8,52%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	57.128.542,56	12,17%		701.101.163,84	8,15%	OK	OK	OK	1,65%	3,08%	6,35%	11,93%	6,33%	
BRADESCO FI RF IMA B	30.172.389,12	6,43%		968.866.712,94	3,11%	OK	OK	OK	2,63%	4,85%	6,64%	13,94%	8,72%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.317.560,95	1,13%		52.328.220,26	10,16%	OK	OK	OK	1,68%	3,14%	6,32%	-	6,30%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	21.338.451,00	4,55%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.016.755,38	2,13%		5.602.662.627,47	0,18%	OK	OK	OK	1,00%	3,04%	5,90%	11,77%	4,88%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.311.974,83	1,56%		158.085.635,77	4,63%	OK	OK	OK	1,15%	2,80%	4,92%	9,33%	4,61%	
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	4.009.720,79	0,85%		3.940.142.864,33	0,10%	OK	OK	OK	0,93%	2,83%	5,47%	10,81%	4,53%	
FIDC	4.857.363,30	1,03%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	4.857.363,30	1,03%		269.069.321,07	1,81%	OK	OK	OK	1,13%	3,45%	6,70%	13,37%	5,54%	
FIDC Fechado	417.113,24	0,09%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	248.007,11	0,05%		5.786.842,64	4,29%	OK	OK	OK	-0,40%	-2,41%	-1,95%	151,77%	-1,84%	
FIDC TRENBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	169.106,13	0,04%		3.399.084,70	4,98%	OK	OK	OK	1,99%	-	-	-	-	
Fundo Crédito Privado	24.701.876,36	5,26%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	8.944.120,36	1,91%		90.378.519,82	9,90%	OK	OK	OK	1,02%	4,32%	8,49%	13,95%	7,32%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.402.245,00	1,79%		92.885.992,44	9,05%	OK	OK	OK	1,12%	4,58%	8,62%	14,68%	7,51%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.355.511,00	1,57%		85.414.793,51	8,61%	OK	OK	OK	1,08%	4,52%	8,61%	14,70%	7,47%	
Fundos de Ações Referenciados	45.057.978,38	9,60%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.630.921,05	1,63%		64.649.898,40	11,80%	OK	OK	OK	-4,22%	2,75%	-2,33%	2,46%	5,96%	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.916.942,75	1,05%		27.151.492,56	18,11%	OK	OK	OK	-3,73%	2,92%	-1,60%	3,38%	4,60%	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.759.452,38	1,01%		26.393.325,01	18,03%	OK	OK	OK	-6,00%	2,35%	-4,13%	2,33%	3,99%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.190.134,84	0,68%		542.819.757,58	0,59%	OK	OK	OK	-3,35%	5,95%	-7,24%	-5,17%	0,28%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	24.560.527,36	5,23%		480.864.999,20	5,11%	OK	OK	OK	-4,77%	2,01%	-3,99%	1,53%	2,76%	
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	36.246.898,07	7,72%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	11.976.350,83	2,55%		155.797.078,81	7,69%	OK	OK	OK	-4,26%	1,44%	-3,38%	3,16%	3,15%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.264.399,77	1,12%		319.518.942,05	1,65%	OK	OK	OK	-0,11%	0,72%	-0,11%	3,36%	0,42%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.134.525,73	0,88%		138.536.644,10	2,98%	OK	OK	OK	-7,17%	-4,76%	-12,26%	-13,00%	-3,93%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	7.864.762,84	1,68%		154.519.988,05	5,09%	OK	OK	OK	-3,59%	1,04%	-10,25%	-8,99%	-6,47%	
LUL AMERICA TOTAL RETURN FIA	6.392.143,10	1,36%		59.329.397,97	10,77%	OK	OK	OK	-6,91%	-1,54%	-20,70%	-22,30%	-15,47%	
VOTORANTIM FI VISION EM ACOES	614.715,80	0,13%		9.563.162,32	6,43%	OK	OK	OK	-2,83%	0,73%	-11,09%	-14,69%	-6,61%	
Fundos Multimercados	2.454.543,50	0,52%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.454.543,50	0,52%		185.801.202,04	1,32%	OK	OK	OK	1,05%	4,45%	6,09%	12,82%	5,33%	
Fundos de Participações	5.586.376,24	1,19%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	232.617,45	0,05%		105.187.979,12	0,22%	OK	OK	OK	-0,62%	-1,89%	-4,14%	-6,44%	-3,47%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	921.727,08	0,20%		232.767.054,50	0,40%	OK	OK	OK	-0,51%	-15,60%	-17,36%	-16,39%	-20,63%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.432.031,71	0,94%		31.467.425,19	14,08%	OK	OK	OK	-0,27%	-1,01%	-1,72%	-3,26%	-1,44%	
Fundos de Investimento Imobiliários	13.460.275,22	2,87%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	6.300.000,00	1,34%		191.071.030,63	3,30%	OK	OK	OK	6,78%	-4,54%	-10,00%	-16,00%	-4,55%	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.160.275,22	1,53%		127.352.059,96	5,62%	OK	OK	OK	-0,61%	-2,79%	2,43%	-4,89%	0,71%	
Disponibilidades Financeiras	133.972,84	0,03%												

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.