

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

31/03/2015

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	453.606.990,53		161,00%							0,49%	3,07%	4,77%	12,62%	3,07%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										2,00%	5,74%	8,94%	14,92%	5,74%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,81%	5,35%	8,74%	14,62%	5,35%
Títulos Públicos	43.151.791,35	9,51%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV FFIN2	43.151.791,35	9,51%								1,63%	4,56%	7,06%	12,80%	4,56%
Fundos que contenham somente títulos públicos	129.379.774,46	28,52%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	52.932.302,22	11,67%		3.199.763.695,05	1,65%	OK	OK	OK	OK	0,97%	4,16%	6,29%	12,84%	4,16%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	23.991.977,68	5,29%		1.674.120.590,06	1,43%	OK	OK	OK	OK	0,99%	4,24%	6,26%	12,67%	4,24%
SANTANDER FICFI IMA B TIT PUB RENDA FIXA	52.455.494,56	11,56%		225.057.977,51	23,31%	OK	OK	OK	OK	-0,32%	3,28%	5,18%	14,14%	3,28%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	132.096.083,19	29,12%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	43.185.172,43	9,52%		1.288.420.870,62	3,35%	OK	OK	OK	OK	-0,35%	3,23%	5,56%	15,39%	3,23%
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	55.034.451,83	12,13%		532.033.826,39	10,34%	OK	OK	OK	OK	0,97%	4,15%	6,21%	12,61%	4,15%
BRADESCO FI RF IMA B	28.673.122,44	6,32%		940.204.586,54	3,05%	OK	OK	OK	OK	-0,36%	3,31%	5,99%	15,49%	3,31%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.203.336,49	1,15%		40.321.209,90	12,90%	OK	OK	OK	OK	0,93%	4,02%	6,19%	-	4,02%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	18.594.920,29	4,10%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	9.823.641,88	2,17%		5.570.338.004,94	0,18%	OK	OK	OK	OK	1,05%	2,86%	5,75%	11,49%	2,86%
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.164.836,51	1,58%		185.100.850,27	3,87%	OK	OK	OK	OK	0,74%	2,50%	4,09%	9,65%	2,50%
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	1.606.441,90	0,35%		3.908.014.319,17	0,04%	OK	OK	OK	OK	0,99%	2,65%	5,30%	10,53%	2,65%
FIDC	4.695.348,24	1,04%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	4.695.348,24	1,04%		263.547.869,90	1,78%	OK	OK	OK	OK	1,19%	3,23%	6,52%	13,04%	3,23%
FIDC Fechado	414.848,23	0,09%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	247.705,35	0,05%		5.779.801,55	4,29%	OK	OK	OK	OK	-2,53%	-1,96%	-0,05%	-9,86%	-1,96%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	167.142,88	0,04%		3.359.307,40	4,98%	OK	OK	OK	OK	1,72%	-	-	-	-
Fundo Crédito Privado	24.093.412,25	5,31%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Desenquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	8.744.516,25	1,93%		88.361.557,36	9,90%	OK	OK	OK	OK	1,99%	4,93%	8,07%	13,92%	4,93%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.180.405,00	1,80%		90.433.584,72	9,05%	OK	OK	OK	OK	1,81%	4,67%	7,80%	14,36%	4,67%
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.168.491,00	1,58%		83.243.040,95	8,61%	OK	OK	OK	OK	1,86%	4,74%	7,86%	14,51%	4,74%
Fundos de Ações Referenciados	43.398.522,06	9,57%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.393.217,32	1,63%		63.881.192,62	11,57%	OK	OK	OK	OK	-0,45%	2,66%	-5,00%	-0,13%	2,66%
BGT PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.839.923,36	1,07%		28.263.265,29	17,12%	OK	OK	OK	OK	1,31%	2,97%	0,17%	4,17%	2,97%
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.628.269,95	1,02%		32.088.881,58	14,42%	OK	OK	OK	OK	-0,47%	1,12%	-5,44%	1,47%	1,12%
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.112.341,00	0,69%		538.494.923,50	0,58%	OK	OK	OK	OK	3,36%	-2,17%	-8,20%	-1,85%	-2,17%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	19.605.672,01	4,32%		217.631.482,51	9,01%	OK	OK	OK	OK	0,97%	1,72%	-2,16%	2,85%	1,72%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	3.819.098,42	0,84%		474.960.711,11	0,80%	OK	OK	OK	OK	1,08%	1,82%	-1,59%	2,63%	1,82%
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	36.425.921,72	8,03%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	11.963.108,40	2,64%		166.637.497,34	7,18%	OK	OK	OK	OK	1,34%	3,05%	-2,26%	5,08%	3,05%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.183.174,84	1,14%		314.588.958,87	1,65%	OK	OK	OK	OK	-0,84%	-1,13%	1,41%	5,22%	-1,13%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.125.593,31	0,91%		151.540.539,16	2,72%	OK	OK	OK	OK	-4,97%	-4,13%	-17,39%	-12,76%	-4,13%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	8.066.562,90	1,78%		167.373.500,54	4,82%	OK	OK	OK	OK	3,63%	-4,07%	-7,48%	-0,72%	-4,07%
SUL AMERICA TOTAL RETURN FIA	6.477.236,28	1,43%		71.530.371,42	9,06%	OK	OK	OK	OK	-0,22%	-14,35%	-17,61%	-16,66%	-14,35%
VOTORANTIM FI VISION EM ACOES	610.245,99	0,13%		9.862.304,87	6,19%	OK	OK	OK	OK	1,00%	-6,37%	-13,63%	-9,79%	-6,37%
Fundos Multimercados	2.417.295,48	0,53%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.417.295,48	0,53%		161.658.340,32	1,50%	OK	OK	OK	OK	2,87%	3,74%	7,91%	13,56%	3,74%
Fundos de Participações	5.645.759,07	1,24%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	237.104,83	0,05%		106.507.556,75	0,22%	OK	OK	OK	OK	-0,66%	-2,26%	-1,60%	-6,25%	-2,26%
BGT PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	931.260,59	0,21%		274.471.477,80	0,40%	OK	OK	OK	OK	-0,48%	-6,41%	-3,13%	-1,80%	-6,41%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.477.393,65	0,99%		31.636.239,98	14,15%	OK	OK	OK	OK	-0,48%	-0,91%	-1,72%	0,71%	-0,91%
Fundos de Investimento Imobiliários	13.244.085,27	2,92%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	6.100.000,00	1,34%		190.925.019,99	3,19%	OK	OK	OK	OK	-7,57%	-7,58%	-15,28%	-32,22%	-7,58%
FII RB CAPITAL RENDA II	7.144.085,27	1,57%		126.697.774,14	5,64%	OK	OK	OK	OK	-2,92%	0,57%	-10,74%	-3,58%	0,57%
Disponibilidades Financeiras	49.228,92	0,01%												

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.