

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

30/11/2015

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	486.595.766,09	100,00%	161,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,50%	2,51%	1,69%	5,88%	8,00%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,60%	3,91%	7,13%	17,63%	16,33%	
										1,50%	3,89%	7,14%	17,10%	15,64%	
Títulos Públicos	81.671.172,30	16,78%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A									
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	81.671.172,30	16,78%								0,92%	3,83%		10,41%	9,74%	
Fundos que contenham somente títulos públicos	124.561.833,66	25,60%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B									
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	52.599.554,85	10,81%		3.693.337.240,60	1,42%	OK	OK	OK	0,55%	3,45%	5,81%	12,62%	12,56%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	22.957.697,64	4,72%		1.631.133.719,64	1,41%	OK	OK	OK	0,51%	3,50%	5,87%	12,60%	12,60%		
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	49.004.581,17	10,07%		986.557.543,08	4,97%	OK	OK	OK	0,53%	3,59%	6,03%	12,90%	12,87%		
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	128.543.161,74	26,42%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A									
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	34.880.701,34	7,17%		901.110.215,67	3,87%	OK	OK	OK	1,02%	2,12%	-1,38%	4,97%	7,02%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	58.330.558,94	11,99%		1.150.167.990,03	5,07%	OK	OK	OK	0,52%	3,47%	5,83%	12,55%	12,53%		
BRADESCO FI RF IMA B	29.725.731,92	6,11%		1.000.474.517,49	2,97%	OK	OK	OK	1,04%	2,18%	-1,48%	5,06%	7,11%		
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.606.169,54	1,15%		125.376.151,32	4,47%	OK	OK	OK	0,53%	3,28%	5,43%	12,09%	12,07%		
Fundos de Renda Fixa (Normal)	23.576.561,59	4,85%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A									
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.701.655,17	2,20%		6.655.383.301,73	0,16%	OK	OK	OK	1,05%	3,37%	6,84%	13,14%	12,05%		
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.680.519,29	1,58%		127.643.931,41	6,02%	OK	OK	OK	0,97%	2,54%	5,04%	10,21%	9,88%		
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	5.194.387,13	1,07%		5.105.298.704,61	0,10%	OK	OK	OK	1,00%	3,17%	6,44%	12,26%	11,26%		
FIDC	5.239.240,56	1,08%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI									
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	5.239.240,56	1,08%		276.803.543,22	1,89%	OK	OK	OK	1,21%	3,87%	7,86%	15,09%	13,84%		
FIDC Fechado	366.981,86	0,08%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A									
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	217.855,27	0,04%		5.083.298,67	4,29%	OK	OK	OK	-0,14%	-4,81%	-12,16%	-13,87%	-13,78%		
FIDC TRENDBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	149.126,59	0,03%		2.997.269,08	4,98%	OK	OK	OK	-5,93%	-	-11,81%	-	-		
Fundo Crédito Privado	26.351.228,58	5,42%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B									
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.553.101,58	1,96%		96.532.150,91	9,90%	OK	OK	OK	1,27%	3,37%	6,81%	15,88%	14,63%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.956.310,00	1,84%		99.011.136,55	9,05%	OK	OK	OK	1,21%	3,08%	6,59%	15,78%	14,60%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.841.817,00	1,61%		91.061.902,99	8,61%	OK	OK	OK	1,22%	3,21%	6,61%	15,79%	14,58%		
Fundos de Ações Referenciados	40.616.110,34	8,35%	15,00%			Art. 8o, Inciso I									
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.559.696,38	1,35%		37.334.793,33	17,57%	OK	OK	OK	-2,33%	-4,95%	-14,04%	-16,04%	-8,92%		
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.554.025,04	0,94%		24.024.827,40	18,96%	OK	OK	OK	-0,63%	-2,65%	-7,38%	-8,86%	-3,12%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.084.609,67	0,84%		18.090.473,67	22,58%	OK	OK	OK	-0,92%	-4,11%	-14,18%	-17,72%	-10,75%		
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.240.215,84	0,67%		512.942.417,54	0,63%	OK	OK	OK	2,78%	3,97%	1,57%	-5,79%	1,85%		
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	22.177.563,41	4,56%		432.759.917,92	5,12%	OK	OK	OK	-0,98%	-3,27%	-9,70%	-13,30%	-7,21%		
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II									
Fundos de Ações	34.195.897,49	7,03%	15,00%			Art. 8o, Inciso III									
ARX INCOME FI EM ACOES	11.246.379,12	2,31%		116.609.655,54	9,64%	OK	OK	OK	1,20%	-0,45%	-6,09%	-9,26%	-3,13%		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.266.047,30	1,29%		1.444.220.839,65	0,43%	OK	OK	OK	-2,09%	-6,37%	-7,65%	-4,51%	0,98%		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.067.981,74	1,04%		307.597.415,48	1,65%	OK	OK	OK	2,03%	3,81%	-3,73%	-3,84%	-3,33%		
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.412.713,42	0,70%		86.010.570,68	3,97%	OK	OK	OK	-6,17%	-7,39%	-17,46%	-27,57%	-20,70%		
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	8.202.775,91	1,69%		98.656.244,61	8,31%	OK	OK	OK	1,04%	6,07%	2,47%	-6,40%	-2,45%		
Fundos Multimercados	2.627.543,37	0,54%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV									
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.627.543,37	0,54%		208.572.662,25	1,26%	OK	OK	OK	1,51%	2,90%	7,05%	13,57%	12,76%		
Fundos de Participações	6.574.041,98	1,35%	5,00%			Art. 8o, Inciso V									
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	374.615,26	0,08%		169.212.078,10	0,22%	OK	OK	OK	-0,41%	-1,27%	5,03%	0,68%	1,39%		
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	716.112,50	0,15%		180.842.282,00	0,40%	OK	OK	OK	-0,66%	-24,06%	-22,31%	-35,80%	-38,34%		
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.483.314,22	1,13%		38.931.530,96	14,08%	OK	OK	OK	0,02%	1,36%	0,44%	-1,30%	-1,01%		
Fundos de Investimento Imobiliários	11.724.981,28	2,41%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI									
DOMO FII	4.800.000,00	0,99%		191.410.289,31	2,51%	OK	OK	OK	-2,44%	-17,95%	-23,81%	-31,43%	-27,28%		
FII RB CAPITAL RENDA II	6.924.981,28	1,42%		130.504.448,51	5,31%	OK	OK	OK	-2,46%	-4,08%	-3,63%	-1,29%	-2,95%		
Disponibilidades Financeiras	547.011,34	0,11%													

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.