

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

30/10/2015

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	482.050.584,03	100,00%	161,00%																	
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,98%	0,03%	1,84%	7,53%	7,40%						
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,26%	3,03%	7,00%	16,95%	14,50%						
										1,31%	3,08%	6,86%	16,53%	13,92%						
Títulos Públicos	83.315.381,22	17,28%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A														
CARTEIRA PRÓPRIA FFIN2	83.315.381,22	17,28%								2,67%	0,23%		10,55%	8,74%						
Fundos que contenham somente títulos públicos	123.824.591,94	25,69%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B														
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	52.236.569,46	10,84%		3.593.804.948,31	1,45%	OK	OK	OK	2,43%	2,62%	7,00%	13,15%	11,94%							
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	22.840.278,88	4,74%		1.630.733.233,88	1,40%	OK	OK	OK	2,44%	2,70%	7,01%	13,17%	12,02%							
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	48.747.743,60	10,11%		971.454.138,10	5,02%	OK	OK	OK	2,47%	2,79%	7,20%	13,45%	12,28%							
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	126.853.874,02	26,32%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A														
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	34.529.304,73	7,16%		923.089.696,51	3,74%	OK	OK	OK	2,44%	-1,35%	0,14%	6,07%	5,94%							
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	57.327.419,62	11,89%		1.118.575.406,06	5,13%	OK	OK	OK	2,43%	2,65%	7,02%	13,12%	11,95%							
BRADESCO FI RF IMA B	29.420.635,40	6,10%		1.006.382.558,36	2,92%	OK	OK	OK	2,51%	-1,50%	0,07%	6,49%	6,01%							
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.576.514,27	1,16%		115.292.554,96	4,84%	OK	OK	OK	2,43%	2,24%	6,64%	12,64%	11,48%							
Fundos de Renda Fixa (Normal)	20.035.133,81	4,16%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A														
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.590.097,12	2,20%		6.566.406.853,04	0,16%	OK	OK	OK	1,11%	3,38%	6,78%	12,91%	10,88%							
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.606.703,45	1,58%		123.736.607,10	6,15%	OK	OK	OK	0,98%	2,10%	5,23%	10,00%	8,82%							
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	1.838.333,24	0,38%		4.760.970.669,20	0,04%	OK	OK	OK	1,04%	3,17%	6,36%	12,01%	10,16%							
FIDC	5.176.380,64	1,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI														
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	5.176.380,64	1,07%		279.130.893,96	1,85%	OK	OK	OK	1,27%	3,87%	7,77%	14,80%	12,47%							
FIDC Fechado	376.756,76	0,08%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A														
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	218.162,44	0,05%		5.090.465,97	4,29%	OK	OK	OK	-2,61%	-7,06%	-12,39%	-12,18%	-13,66%							
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	158.594,32	0,03%		3.187.794,17	4,98%	OK	OK	OK	-2,57%	-	-4,35%	-	-							
Fundo Crédito Privado	26.029.071,11	5,40%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B														
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.433.124,61	1,96%		95.319.796,52	9,90%	OK	OK	OK	1,17%	2,89%	6,54%	15,38%	13,19%							
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.848.985,00	1,84%		97.824.669,70	9,05%	OK	OK	OK	1,06%	2,85%	6,50%	15,35%	13,23%							
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.746.961,50	1,61%		89.960.427,62	8,61%	OK	OK	OK	1,13%	2,88%	6,46%	15,33%	13,19%							
Fundos de Ações Referenciados	40.970.440,50	8,50%	15,00%			Art. 8o, Inciso I														
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.716.239,85	1,39%		38.527.887,29	17,43%	OK	OK	OK	1,23%	-9,18%	-15,70%	-14,51%	-6,74%							
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.582.799,31	0,95%		24.176.628,58	18,96%	OK	OK	OK	1,29%	-6,44%	-10,27%	-6,43%	-2,50%							
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.122.639,81	0,86%		22.009.981,36	18,73%	OK	OK	OK	1,25%	-10,11%	-18,58%	-15,87%	-9,92%							
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.152.484,51	0,65%		502.928.607,02	0,63%	OK	OK	OK	-0,60%	-4,93%	-4,49%	-5,69%	-0,91%							
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	22.396.277,02	4,65%		448.431.067,91	4,99%	OK	OK	OK	0,78%	-7,50%	-13,16%	-10,92%	-6,29%							
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II														
Fundos de Ações	34.235.077,20	7,10%	15,00%			Art. 8o, Inciso III														
ARX INCOME FI EM ACOES	11.112.625,98	2,31%		115.780.370,79	9,60%	OK	OK	OK	-1,75%	-6,42%	-11,16%	-8,38%	-4,28%							
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.399.840,14	1,33%		1.452.422.146,28	0,44%	OK	OK	OK	-1,66%	-8,41%	-8,31%	0,39%	3,13%							
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.967.050,93	1,03%		301.471.481,76	1,65%	OK	OK	OK	4,24%	-4,26%	-5,75%	-4,91%	-5,26%							
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.637.083,11	0,75%		95.197.080,02	3,82%	OK	OK	OK	5,19%	-10,38%	-18,34%	-24,13%	-15,49%							
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	8.118.477,04	1,68%		100.935.498,54	8,04%	OK	OK	OK	3,85%	2,01%	-0,48%	-7,03%	-3,45%							
Fundos Multimercados	2.588.421,51	0,54%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV														
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.588.421,51	0,54%		212.530.105,51	1,22%	OK	OK	OK	-0,58%	1,91%	6,56%	14,03%	11,08%							
Fundos de Participações	6.580.668,29	1,37%	5,00%			Art. 8o, Inciso V														
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	376.149,42	0,08%		169.905.054,94	0,22%	OK	OK	OK	-0,42%	6,94%	4,81%	3,51%	1,80%							
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	720.860,22	0,15%		182.041.238,60	0,40%	OK	OK	OK	-23,12%	-23,94%	-22,20%	-35,56%	-37,93%							
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.483.658,65	1,14%		38.933.976,44	14,08%	OK	OK	OK	1,65%	1,08%	0,18%	-1,54%	-1,01%							
Fundos de Investimento Imobiliários	12.039.260,68	2,50%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI														
DOMO FII	4.920.000,00	1,02%		191.335.494,32	2,57%	OK	OK	OK	-5,38%	-20,00%	-16,61%	-31,28%	-25,46%							
FII RB CAPITAL RENDA II	7.119.260,68	1,48%		124.018.099,85	5,74%	OK	OK	OK	2,97%	-2,17%	-1,81%	-11,51%	-0,50%							
Disponibilidades Financeiras	25.526,35	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.