

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV FFIN2**

**30/09/2015**

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			
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>471.379.284,03</b>	<b>100,00%</b>	<b>161,00%</b>													
META ATUARIAL ( INPC + 6%)																
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)																
<b>Títulos Públicos</b>	<b>81.150.753,09</b>	<b>17,22%</b>	<b>20,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>										
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	81.150.753,09	17,22%								0,21%	-2,47%				1,30%	8,45%
																5,91%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>120.793.166,22</b>	<b>25,63%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>										
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	50.924.267,39	10,80%		3.425.801.215,68	1,49%	OK	OK	OK	0,70%	1,95%	4,92%	11,53%	9,29%			
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	22.295.254,20	4,73%		1.599.833.756,41	1,39%	OK	OK	OK	0,76%	1,99%	4,90%	11,47%	9,35%			
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	47.573.644,63	10,09%		881.890.086,93	5,39%	OK	OK	OK	0,81%	2,09%	5,06%	11,79%	9,57%			
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>123.363.828,77</b>	<b>26,17%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>										
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	33.705.436,39	7,15%		929.372.251,93	3,63%	OK	OK	OK	-0,67%	-4,43%	0,18%	5,75%	3,41%			
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	55.514.807,16	11,78%		1.076.382.657,16	5,16%	OK	OK	OK	0,74%	1,96%	4,93%	11,45%	9,29%			
BRADESCO FI RF IMA B	28.699.620,71	6,09%		1.000.751.729,82	2,87%	OK	OK	OK	-0,70%	-4,63%	0,09%	6,09%	3,41%			
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.443.964,51	1,15%		90.470.920,47	6,02%	OK	OK	OK	0,57%	1,58%	4,62%	11,11%	8,83%			
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>19.875.676,92</b>	<b>4,22%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>										
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.474.226,14	2,22%		6.598.035.938,54	0,16%	OK	OK	OK	1,12%	3,45%	6,62%	12,75%	9,67%			
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.532.574,70	1,60%		128.981.438,85	5,84%	OK	OK	OK	0,63%	1,87%	5,13%	9,43%	7,76%			
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	1.868.877,08	0,40%		4.542.511.938,58	0,04%	OK	OK	OK	1,05%	3,26%	6,21%	11,84%	9,03%			
<b>FIDC</b>	<b>5.111.219,84</b>	<b>1,08%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>										
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	5.111.219,84	1,08%		275.617.166,22	1,85%	OK	OK	OK	1,27%	3,95%	7,58%	14,59%	11,06%			
<b>FIDC Fechado</b>	<b>386.159,04</b>	<b>0,08%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>										
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	224.005,35	0,05%		5.226.800,67	4,29%	OK	OK	OK	-1,20%	-6,19%	-9,57%	-9,61%	-11,34%			
FIDC TRENDBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	162.153,69	0,03%		3.259.338,68	4,98%	OK	OK	OK	-2,84%	-2,82%	-0,41%	1669,33%	-1,31%			
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>25.740.527,54</b>	<b>5,46%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>										
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.323.953,04	1,98%		94.216.664,70	9,90%	OK	OK	OK	0,86%	2,89%	6,63%	15,24%	11,88%			
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.756.355,00	1,86%		96.800.622,93	9,05%	OK	OK	OK	0,74%	2,98%	7,04%	15,39%	12,04%			
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.660.219,50	1,63%		88.953.132,23	8,61%	OK	OK	OK	0,78%	2,86%	6,86%	15,26%	11,93%			
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>40.624.506,47</b>	<b>8,62%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>										
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.634.716,22	1,41%		38.060.224,86	17,43%	OK	OK	OK	-2,83%	-14,07%	-10,26%	-14,74%	-7,88%			
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.524.244,08	0,96%		23.867.717,35	18,96%	OK	OK	OK	-1,89%	-8,96%	-6,52%	-6,36%	-3,75%			
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.071.786,44	0,86%		23.135.587,77	17,60%	OK	OK	OK	-4,41%	-14,80%	-12,02%	-16,81%	-11,03%			
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.171.407,56	0,67%		509.892.656,82	0,62%	OK	OK	OK	2,37%	-1,93%	1,90%	-6,46%	-0,31%			
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	22.222.352,17	4,71%		448.258.525,40	4,96%	OK	OK	OK	-1,67%	-10,09%	-8,68%	-10,13%	-7,02%			
<b>Fundos de Índices de Ações</b>			<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>										
<b>Fundos de Ações</b>	<b>33.858.651,36</b>	<b>7,18%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>										
ARX INCOME FI EM ACOES	11.310.075,65	2,40%		119.117.429,56	9,49%	OK	OK	OK	0,88%	-6,98%	-5,46%	-7,60%	-2,58%			
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.507.995,63	1,38%		1.458.410.132,34	0,45%	OK	OK	OK	-1,47%	-6,30%	-0,42%	6,47%	4,88%			
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.765.027,87	1,01%		289.209.919,35	1,65%	OK	OK	OK	-0,89%	-9,15%	-8,07%	-6,77%	-9,11%			
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.457.741,43	0,73%		92.909.872,37	3,72%	OK	OK	OK	-5,38%	-15,37%	-16,19%	-30,76%	-19,65%			
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	7.817.810,78	1,66%		98.519.905,55	7,94%	OK	OK	OK	1,37%	-1,27%	-3,08%	-10,34%	-7,03%			
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>2.603.494,82</b>	<b>0,55%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>										
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.603.494,82	0,55%		216.172.142,08	1,20%	OK	OK	OK	1,91%	4,92%	7,70%	16,23%	11,73%			
<b>Fundos de Participações</b>	<b>5.758.028,74</b>	<b>1,22%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>										
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	377.740,91	0,08%		170.623.927,00	0,22%	OK	OK	OK	-0,41%	6,60%	4,59%	2,92%	2,23%			
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	937.613,87	0,20%		236.778.765,80	0,40%	OK	OK	OK	-0,54%	2,31%	-13,73%	-16,43%	-19,26%			
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.442.673,96	0,94%		31.542.985,13	14,08%	OK	OK	OK	-0,27%	-0,71%	-1,72%	-3,41%	-2,62%			
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>12.097.998,03</b>	<b>2,57%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>										
DOMO FII	5.200.000,00	1,10%		191.246.594,40	2,72%	OK	OK	OK	-11,86%	-17,46%	-14,75%	-27,78%	-21,22%			
FII RB CAPITAL RENDA II	6.897.998,03	1,46%		127.576.452,57	5,41%	OK	OK	OK	-4,10%	-4,64%	-3,92%	-14,24%	-3,37%			
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>15.273,19</b>	<b>0,003%</b>														

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.