

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV FFIN2**

**30/12/2016**

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	
RF	506.659.917,11	81,92%	164,00%							3,18%	3,54%	8,03%	19,67%	19,67%
RV	111.701.489,43	18,06%	47,00%							-1,41%	0,82%	11,19%	21,58%	21,58%
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>618.467.754,80</b>	<b>100,00%</b>	<b>211,00%</b>							<b>2,35%</b>	<b>3,30%</b>	<b>8,89%</b>	<b>20,49%</b>	<b>20,49%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										0,63%	1,85%	4,42%	12,97%	12,97%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										0,79%	2,22%	4,80%	12,67%	12,67%
<b>Títulos Públicos</b>	<b>118.942.649,93</b>	<b>19,23%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	118.942.649,93	19,24%								3,07%	2,67%	7,55%	22,32%	22,32%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>171.146.406,85</b>	<b>27,67%</b>	<b>50,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	1.403.006,15	0,23%		3.466.342.099,07	0,04%	OK	OK	OK	1,81%	3,35%	7,81%	23,21%	23,21%	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	12.170.480,92	1,97%		67.083.609,11	18,14%	OK	OK	OK	2,83%	2,39%	7,58%	23,98%	23,98%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	53.710.790,49	8,69%		1.520.412.873,64	3,53%	OK	OK	OK	1,81%	3,41%	7,88%	23,26%	23,26%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	42.731.412,63	6,91%		5.450.485.822,27	0,78%	OK	OK	OK	1,38%	2,23%	6,01%	15,19%	15,19%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.050.992,53	0,98%		1.893.493.369,33	0,32%	OK	OK	OK	1,36%	2,17%	5,90%	15,02%	15,02%	
SAFRA IMA FIC FI RF	8.541.589,39	1,38%		347.599.459,09	2,46%	OK	OK	OK	2,75%	2,10%	7,10%	22,47%	22,47%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	46.538.134,74	7,53%		1.331.744.011,26	3,49%	OK	OK	OK	1,38%	2,22%	6,01%	15,27%	15,27%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa</b>	<b>157.915.695,93</b>	<b>25,53%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	48.367.837,20	7,82%		1.970.956.693,10	2,45%	OK	OK	OK	1,36%	2,20%	6,01%	15,28%	15,28%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	44.864.418,86	7,26%		1.109.454.048,62	4,04%	OK	OK	OK	2,88%	2,30%	7,59%	24,46%	24,46%	
BRADESCO FI RF IMA B	40.836.783,49	6,60%		1.271.470.620,48	3,21%	OK	OK	OK	3,00%	2,42%	7,69%	24,64%	24,64%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	23.846.656,38	3,86%		280.924.433,97	8,49%	OK	OK	OK	1,42%	2,25%	6,01%	15,33%	15,33%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>51.911.133,22</b>	<b>8,39%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	12.369.293,38	2,00%		7.364.690.538,54	0,17%	OK	OK	OK	1,12%	3,45%	7,06%	14,25%	14,25%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	22.979.222,80	3,72%		1.223.348.136,08	1,88%	OK	OK	OK	2,12%	2,91%	7,50%	21,48%	21,48%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	11.865.056,70	1,92%		181.849.739,25	6,52%	OK	OK	OK	1,38%	2,08%	5,69%	13,76%	13,76%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	4.697.560,34	0,76%		8.642.263.777,66	0,05%	OK	OK	OK	1,06%	3,07%	6,44%	13,14%	13,14%	
<b>FIDC</b>	<b>6.169.271,30</b>	<b>1,00%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	6.169.271,30	1,00%		341.294.642,28	1,81%	OK	OK	OK	1,29%	3,74%	7,89%	16,27%	16,27%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>574.759,88</b>	<b>0,09%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC MULTISERIAL BVA MASTER II SENIOR	458.104,23	0,07%		10.689.117,45	4,29%	OK	OK	OK	1116,38%	992,85%	7392,99%	14873,73%	14873,73%	
FIDC TRENBANK MULTISERIAL 2 SEN	116.655,65	0,02%		2.344.814,09	4,98%	OK	OK	OK	-3,64%	-8,37%	-3,35%	-19,01%	-19,01%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>42.228.328,20</b>	<b>6,83%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	8.732.920,37	1,41%		36.759.407,24	23,76%	OK	OK	OK	-1,40%	3,47%	18,12%	35,59%	35,59%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.380.582,49	0,87%		522.144.503,14	1,03%	OK	OK	OK	1,42%	6,30%	19,67%	5,01%	5,01%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	28.114.825,34	4,55%		481.259.581,68	5,84%	OK	OK	OK	-1,50%	1,13%	10,86%	29,55%	29,55%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>5.423.297,71</b>	<b>0,88%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.423.297,71	0,88%		21.048.707,21	25,77%	OK	OK	OK	-2,69%	3,24%	16,78%	38,35%	38,35%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>41.580.512,79</b>	<b>6,72%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	16.426.214,83	2,66%		122.233.588,40	13,44%	OK	OK	OK	-4,40%	1,95%	19,65%	32,55%	32,55%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.958.715,70	0,80%		132.355.463,52	3,75%	OK	OK	OK	-0,77%	13,81%	28,73%	48,74%	48,74%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.122.995,48	0,51%		264.031.286,09	1,18%	OK	OK	OK	2,22%	0,52%	12,40%	-1,64%	-1,64%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	1.926.666,21	0,31%		106.800.985,65	1,80%	OK	OK	OK	-1,78%	1,93%	17,71%	25,97%	25,97%	
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	9.444.379,31	1,53%		143.257.865,60	6,59%	OK	OK	OK	2,26%	2,38%	9,05%	20,08%	20,08%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.701.541,26	0,92%		346.050.816,64	1,65%	OK	OK	OK	-0,53%	-0,47%	5,55%	12,37%	12,37%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>2.911.049,05</b>	<b>0,47%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.911.049,05	0,47%		134.932.165,03	2,16%	OK	OK	OK	0,70%	3,49%	6,49%	9,28%	9,28%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>7.705.894,67</b>	<b>1,25%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	503.221,52	0,08%		226.791.506,10	0,22%	OK	OK	OK	-0,10%	-0,28%	-6,40%	-3,01%	-3,01%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.370.623,05	1,03%		45.231.423,61	14,08%	OK	OK	OK	-0,24%	-11,58%	-10,96%	-20,39%	-20,39%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	832.050,10	0,13%		210.120.389,30	0,40%	OK	OK	OK	-0,60%	-1,65%	-3,60%	-18,20%	-18,20%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>11.852.407,01</b>	<b>1,92%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	4.840.000,00	0,78%		162.124.042,52	2,99%	OK	OK	OK	-11,52%	-21,94%	-6,91%	-17,26%	-17,26%	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.012.407,01	1,13%		125.453.684,08	5,59%	OK	OK	OK	1,91%	1,64%	8,15%	9,06%	9,06%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>106.348,26</b>	<b>0,017%</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.