ENQUADRAMENTO LEGAL

SBCPREV FFIN2 — 29/02/2016

Fundo	Valor Investido R$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	Adequação Fundo	Diversificação RPPS	Diversificação Fundo	Rentabilidades 1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano
CONSOLIDADO	**516.290.303,57**	**100,00%**	**211,00%**						**1,91%**	**5,14%**	**7,71%**	**10,29%**	**3,27%**
META ATUARIAL (INPC + 6%)									**1,44%**	**4,91%**	**9,02%**	**17,74%**	**3,47%**
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									**1,39%**	**4,68%**	**8,75%**	**16,98%**	**3,18%**
Títulos Públicos	**86.612.923,24**	**16,78%**	**40,00%**			**Art. 7o, Inciso I, Alínea A**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	86.612.923,24	16,78%							2,54%	6,09%	10,15%	13,16%	4,48%
Fundos que contenham somente títulos públicos	**143.500.368,07**	**27,80%**	**50,00%**			**Art. 7o, Inciso I, Alínea B**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	66.533.185,08	12,89%		4.402.467.701,92	1,51%	OK	OK	OK	1,51%	6,60%	10,56%	16,32%	4,47%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	24.673.043,48	4,78%		1.859.358.727,98	1,33%	OK	OK	OK	1,50%	6,66%	10,66%	16,35%	4,48%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	52.294.139,51	10,13%		1.286.007.051,87	4,07%	OK	OK	OK	1,52%	6,71%	10,81%	16,65%	4,52%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	**149.243.226,91**	**28,91%**	**35,00%**			**Art. 7o, Inciso III, Alínea A**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	36.865.928,65	7,14%		853.933.240,91	4,32%	OK	OK	OK	2,21%	5,69%	8,65%	9,19%	4,13%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	64.030.485,49	12,40%		1.405.005.538,60	4,56%	OK	OK	OK	1,52%	6,67%	10,65%	16,38%	4,51%
BRADESCO FI RF IMA B	31.349.992,98	6,07%		1.023.242.068,86	3,06%	OK	OK	OK	2,17%	5,46%	8,47%	8,94%	3,98%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	16.996.819,79	3,29%		223.981.721,32	7,59%	OK	OK	OK	1,52%	6,76%	10,57%	16,09%	4,54%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	**30.731.796,82**	**5,95%**	**30,00%**			**Art. 7o, Inciso IV, Alínea A**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.048.596,24	2,14%		6.543.439.694,39	0,17%	OK	OK	OK	0,99%	3,24%	6,67%	13,65%	2,05%
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.968.662,85	1,54%		128.319.980,47	6,21%	OK	OK	OK	0,86%	3,75%	6,46%	12,04%	2,44%
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	11.714.537,73	2,27%		6.575.704.719,54	0,18%	OK	OK	OK	0,92%	3,03%	6,24%	12,78%	1,92%
FIDC	**5.435.662,93**	**1,05%**	**2,00%**			**Art. 7o, Inciso VI**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.435.662,93	1,05%		287.899.727,31	1,89%	OK	OK	OK	1,15%	3,75%	7,70%	15,77%	2,38%
FIDC Fechado	**366.005,87**	**0,07%**	**2,00%**			**Art. 7o, Inciso VII, Alínea A**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
FIDC MULTISETORIAL BVA MASTER II SENIOR	229.796,73	0,04%		5.361.933,12	4,29%	OK	OK	OK	8,94%	5,48%	1,35%	-9,58%	7,86%
FIDC TRENDBANK MULTISETORIAL 2 SEN	136.209,14	0,03%		2.737.845,23	4,98%	OK	OK	OK	-1,75%	0,00%	-16,02%	-17,11%	-5,37%
Fundo Crédito Privado	**17.544.157,50**	**3,40%**	**5,00%**			**Art. 7o, Inciso VII, Alínea B**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.351.525,00	1,81%		103.380.161,35	9,05%	OK	OK	OK	1,48%	4,41%	7,59%	16,39%	2,89%
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.192.632,50	1,59%		95.135.697,82	8,61%	OK	OK	OK	1,53%	4,47%	7,78%	16,42%	2,92%
Fundos de Ações Referenciados	**31.100.677,16**	**6,02%**	**15,00%**			**Art. 8o, Inciso I**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	6.282.837,18	1,22%		32.367.181,07	19,41%	OK	OK	OK	5,12%	-4,22%	-7,99%	-15,40%	-2,45%
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.009.502,76	0,58%		463.694.123,55	0,65%	OK	OK	OK	2,15%	-7,12%	-2,86%	-0,05%	-6,05%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	21.808.337,22	4,22%		427.720.493,39	5,10%	OK	OK	OK	4,15%	-1,66%	-3,50%	-9,42%	0,49%
Fundos de Índices de Ações	**3.865.042,45**	**0,75%**	**2,00%**			**Art. 8o, Inciso II**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	3.865.042,45	0,75%		16.723.083,89	23,11%	OK	OK	OK	5,66%	-5,38%	-9,27%	-16,88%	-1,40%
Fundos de Ações	**26.960.455,39**	**5,22%**	**15,00%**			**Art. 8o, Inciso III**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
ARX INCOME FI EM ACOES	10.777.483,10	2,09%		100.758.747,12	10,70%	OK	OK	OK	6,73%	-4,17%	-3,87%	-8,71%	-1,33%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.072.386,05	0,98%		307.864.801,65	1,65%	OK	OK	OK	3,07%	0,09%	5,50%	-2,96%	-0,03%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.214.847,58	0,62%		101.299.390,74	3,17%	OK	OK	OK	5,03%	-5,80%	-12,03%	-25,95%	-3,57%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	7.895.738,66	1,53%		88.221.523,81	8,95%	OK	OK	OK	0,82%	-3,74%	2,38%	1,44%	0,39%
Fundos Multimercados	**2.688.987,89**	**0,52%**	**5,00%**			**Art. 8o, Inciso IV**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.688.987,89	0,52%		192.367.382,84	1,40%	OK	OK	OK	0,13%	2,34%	5,25%	14,43%	0,94%
Fundos de Participações	**6.883.560,25**	**1,33%**	**5,00%**			**Art. 8o, Inciso V**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	369.835,77	0,07%		167.053.212,92	0,22%	OK	OK	OK	-0,41%	-1,28%	-2,50%	1,73%	-0,82%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.434.435,21	0,28%		362.242.714,40	0,40%	OK	OK	OK	-0,16%	148,94%	89,10%	63,27%	-0,38%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.079.289,27	0,98%		36.062.953,73	14,08%	OK	OK	OK	-24,09%	-14,65%	-13,48%	-15,15%	-14,83%
Fundos de Investimento Imobiliários	**11.336.962,90**	**2,20%**	**5,00%**			**Art. 8o, Inciso VI**					**Alocação:**	**Enquadrado**	
DOMO FII	5.800.000,00	1,12%		171.120.094,59	3,39%	OK	OK	OK	8,41%	20,83%	-1,69%	-12,12%	-0,85%
FII RB CAPITAL RENDA II	5.536.962,90	1,07%		126.041.007,72	4,39%	OK	OK	OK	4,72%	-16,77%	-19,83%	-22,04%	-10,39%
Disponibilidades Financeiras	**20.476,19**	**0,004%**											

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.