

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

29/01/2016

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				
CONSOLIDADO	503.544.764,34	100,00%	211,00%														
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,33%	3,68%	3,64%	10,31%	1,33%			
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										2,00%	5,08%	8,26%	17,99%	2,00%			
										1,76%	4,79%	8,02%	17,35%	1,76%			
Títulos Públicos	84.471.485,67	16,78%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A											
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	84.471.485,67	16,78%								1,89%	4,41%	4,65%	11,62%	1,89%			
Fundos que contenham somente títulos públicos	141.278.736,05	28,06%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B											
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	65.460.473,98	13,00%		4.198.883.334,36	1,56%	OK	OK	OK		2,91%	5,59%	8,36%	15,89%	2,91%			
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	24.307.590,05	4,83%		1.746.737.329,73	1,39%	OK	OK	OK		2,93%	5,62%	8,47%	15,98%	2,93%			
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	51.510.672,02	10,23%		1.232.640.430,95	4,18%	OK	OK	OK		2,96%	5,67%	8,62%	16,29%	2,96%			
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	146.124.309,21	29,02%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A											
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	36.067.407,80	7,16%		855.918.960,52	4,21%	OK	OK	OK		1,88%	4,45%	3,05%	7,34%	1,88%			
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	62.631.741,32	12,44%		1.202.461.273,48	5,21%	OK	OK	OK		2,95%	5,63%	8,43%	15,94%	2,95%			
BRADESCO FI RF IMA B	30.682.897,24	6,09%		1.020.535.005,25	3,01%	OK	OK	OK		1,76%	4,29%	2,73%	7,25%	1,76%			
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	16.742.262,85	3,32%		171.636.691,42	9,75%	OK	OK	OK		2,97%	5,72%	8,09%	15,60%	2,97%			
Fundos de Renda Fixa (Normal)	26.724.943,76	5,31%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A											
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.939.934,57	2,17%		6.500.223.272,15	0,17%	OK	OK	OK		1,05%	3,30%	6,79%	13,48%	1,05%			
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.901.086,71	1,57%		129.096.125,84	6,12%	OK	OK	OK		1,57%	3,87%	6,05%	11,91%	1,57%			
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	7.883.922,48	1,57%		6.084.472.792,57	0,13%	OK	OK	OK		0,99%	3,12%	6,38%	12,62%	0,99%			
FIDC	5.373.729,27	1,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI											
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	5.373.729,27	1,07%		283.908.953,23	1,89%	OK	OK	OK		1,21%	3,81%	7,83%	15,53%	1,21%			
FIDC Fechado	349.674,36	0,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A											
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	210.938,23	0,04%		4.921.900,57	4,29%	OK	OK	OK		-0,99%	-3,31%	-10,14%	-16,87%	-0,99%			
FIDC TRENDBANK MULTISSETORIAL 2 SEN	138.736,13	0,03%		2.788.638,50	4,98%	OK	OK	OK		-3,62%	-12,52%	-16,02%	-13,73%	-3,62%			
Fundo Crédito Privado	17.284.309,50	3,43%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B											
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.214.950,00	1,83%		101.870.373,74	9,05%	OK	OK	OK		1,39%	4,14%	7,10%	16,35%	1,39%			
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.069.359,50	1,60%		93.704.246,72	8,61%	OK	OK	OK		1,37%	4,16%	7,16%	16,31%	1,37%			
Fundos de Ações Referenciados	29.862.561,32	5,93%	15,00%			Art. 8o, Inciso I											
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	5.976.921,38	1,19%		34.007.993,13	17,58%	OK	OK	OK		-7,20%	-11,01%	-19,17%	-11,72%	-7,20%			
GERACAO FIA PROGRAMADO	2.946.225,10	0,59%		458.206.513,76	0,64%	OK	OK	OK		-8,02%	-6,54%	-11,15%	2,75%	-8,02%			
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	20.939.414,84	4,16%		411.497.965,03	5,09%	OK	OK	OK		-3,51%	-6,50%	-13,52%	-6,39%	-3,51%			
Fundos de Índices de Ações	3.658.044,87	0,73%	2,00%			Art. 8o, Inciso II											
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	3.658.044,87	0,73%		16.201.249,80	22,58%	OK	OK	OK		-6,68%	-11,27%	-20,24%	-13,60%	-6,68%			
Fundos de Ações	25.911.037,25	5,15%	15,00%			Art. 8o, Inciso III											
ARX INCOME FI EM ACOES	10.097.642,10	2,01%		101.629.088,26	9,94%	OK	OK	OK		-7,56%	-9,13%	-14,97%	-7,53%	-7,56%			
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.921.196,68	0,98%		298.688.442,25	1,65%	OK	OK	OK		-3,01%	-0,92%	-5,15%	-0,41%	-3,01%			
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.060.753,77	0,61%		98.179.656,11	3,12%	OK	OK	OK		-8,19%	-15,85%	-24,58%	-22,70%	-8,19%			
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	7.831.444,70	1,56%		88.678.021,83	8,83%	OK	OK	OK		-0,42%	-3,54%	-1,60%	3,83%	-0,42%			
Fundos Multimercados	2.685.462,33	0,53%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV											
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.685.462,33	0,53%		196.375.296,53	1,37%	OK	OK	OK		0,81%	3,75%	5,73%	15,96%	0,81%			
Fundos de Participações	8.499.313,53	1,69%	5,00%			Art. 8o, Inciso V											
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	371.343,01	0,07%		167.734.023,92	0,22%	OK	OK	OK		-0,42%	-1,28%	5,57%	1,50%	-0,42%			
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.436.701,36	0,29%		362.814.991,60	0,40%	OK	OK	OK		-0,24%	0,00%	0,00%	62,82%	-0,24%			
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.691.269,16	1,33%		47.508.011,10	14,08%	OK	OK	OK		12,47%	0,00%	0,00%	11,63%	12,47%			
Fundos de Investimento Imobiliários	10.637.637,67	2,11%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI											
DOMO FI	5.350.000,00	1,06%		170.937.876,70	3,13%	OK	OK	OK		-8,55%	8,74%	-13,01%	-15,21%	-8,55%			
FI RB CAPITAL RENDA II	5.287.637,67	1,05%		125.822.214,09	4,20%	OK	OK	OK		-14,43%	-22,48%	-24,16%	-24,96%	-14,43%			
Disponibilidades Financeiras	683.519,55	0,14%															

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.