

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

29/07/2016

| 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 | 579.357.459,29 | 100,00% | 211,00% | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| META ATUARIAL (INPC + 6%) | | | | | | | | | | 2,81% | 3,63% | 12,26% | 16,34% | 13,76% | | | | | | |
| META ATUARIAL (IPCA + 6%) | | | | | | | | | | 1,13% | 3,60% | 7,27% | 16,13% | 9,42% | | | | | | |
| | | | | | | | | | | 1,01% | 3,15% | 6,71% | 15,26% | 8,59% | | | | | | |
| Títulos Públicos | 95.839.273,11 | 16,54% | 40,00% | | | Art. 7o, Inciso I, Alínea A | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| CARTEIRA PROPRIA FFIN2 | 95.839.273,11 | 16,54% | | | | | | | | 1,89% | 1,17% | 13,73% | 19,02% | 15,89% | | | | | | |
| Fundos que contenham somente títulos públicos | 141.063.327,23 | 24,35% | 50,00% | | | Art. 7o, Inciso I, Alínea B | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP | 10.637.198,39 | 1,84% | | 59.310.532,04 | 17,93% | OK | OK | OK | 2,57% | 4,20% | 16,18% | 19,85% | 18,20% | | | | | | | |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP | 70.569.448,78 | 12,18% | | 5.389.170.257,20 | 1,31% | OK | OK | OK | 1,19% | 2,91% | 6,84% | 15,77% | 9,96% | | | | | | | |
| ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI | 5.780.635,62 | 1,00% | | 2.150.711.919,93 | 0,27% | OK | OK | OK | 1,17% | 2,87% | 6,75% | 15,79% | 9,88% | | | | | | | |
| SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF | 54.076.044,44 | 9,33% | | 1.573.294.917,70 | 3,44% | OK | OK | OK | 1,17% | 2,90% | 6,85% | 16,06% | 10,01% | | | | | | | |
| Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA | 168.802.798,30 | 29,14% | 35,00% | | | Art. 7o, Inciso III, Alínea A | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| SAFRA IMA FIC FI RF | 5.091.844,00 | 0,88% | | 207.625.041,06 | 2,45% | OK | OK | OK | 2,48% | 4,17% | 15,20% | 20,33% | 17,19% | | | | | | | |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC | 64.991.687,85 | 11,22% | | 1.883.872.588,62 | 3,45% | OK | OK | OK | 1,18% | 2,90% | 6,87% | 15,88% | 10,02% | | | | | | | |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI | 41.963.683,94 | 7,24% | | 979.215.484,53 | 4,29% | OK | OK | OK | 2,46% | 4,20% | 16,35% | 19,89% | 18,53% | | | | | | | |
| BRADESCO FI RF IMA B | 38.861.427,56 | 6,71% | | 1.048.846.055,63 | 3,71% | OK | OK | OK | 2,48% | 4,31% | 16,56% | 19,74% | 18,61% | | | | | | | |
| BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5 | 17.894.154,95 | 3,09% | | 227.641.654,14 | 7,86% | OK | OK | OK | 1,16% | 2,81% | 6,88% | 15,53% | 10,06% | | | | | | | |
| Fundos de Renda Fixa (Normal) | 45.165.649,74 | 7,80% | 30,00% | | | Art. 7o, Inciso IV, Alínea A | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | 11.684.392,78 | 2,02% | | 6.069.540.839,85 | 0,19% | OK | OK | OK | 1,13% | 3,47% | 6,80% | 14,06% | 7,93% | | | | | | | |
| ITAU INSTT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 20.286.768,18 | 3,50% | | 754.288.682,39 | 2,69% | OK | OK | OK | 1,68% | 3,84% | 13,31% | 19,27% | 14,90% | | | | | | | |
| QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO | 8.477.803,32 | 1,46% | | 189.196.441,91 | 4,48% | OK | OK | OK | 1,26% | 3,25% | 7,30% | 13,80% | 8,99% | | | | | | | |
| SANTANDER FC MASTER RF REF DI | 4.716.685,46 | 0,81% | | 8.377.097.003,92 | 0,06% | OK | OK | OK | 1,05% | 3,24% | 6,36% | 13,15% | 7,41% | | | | | | | |
| FIDC | 5.794.557,91 | 1,00% | 2,00% | | | Art. 7o, Inciso VI | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1 | 5.794.557,91 | 1,00% | | 311.321.060,72 | 1,86% | OK | OK | OK | 1,27% | 3,94% | 7,83% | 16,28% | 9,14% | | | | | | | |
| FIDC Fechado | 151.415,29 | 0,03% | 2,00% | | | Art. 7o, Inciso VII, Alínea A | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR | 37.716,43 | 0,01% | | 880.051,67 | 4,29% | OK | OK | OK | -5,49% | - | - | -83,93% | -67,66% | | | | | | | |
| FIDC TRENDBANK MULTISSETORIAL 2 SEN | 113.698,86 | 0,02% | | 2.285.381,73 | 4,98% | OK | OK | OK | -5,74% | - | -18,05% | -31,17% | -21,21% | | | | | | | |
| Fundo Crédito Privado | 18.524.891,00 | 3,20% | 5,00% | | | Art. 7o, Inciso VII, Alínea B | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV | 9.880.085,00 | 1,71% | | 109.223.379,58 | 9,05% | OK | OK | OK | 0,93% | 3,29% | 7,22% | 14,83% | 8,70% | | | | | | | |
| CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV | 8.644.806,00 | 1,49% | | 100.386.505,71 | 8,61% | OK | OK | OK | 0,88% | 3,25% | 7,13% | 14,80% | 8,60% | | | | | | | |
| Fundos de Ações Referenciados | 39.111.554,43 | 6,75% | 15,00% | | | Art. 8o, Inciso I | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA | 8.126.240,98 | 1,40% | | 34.668.997,30 | 23,44% | OK | OK | OK | 9,92% | 6,25% | 35,96% | 9,89% | 26,17% | | | | | | | |
| GERACAO FIA PROGRAMADO | 3.108.823,13 | 0,54% | | 477.662.788,62 | 0,65% | OK | OK | OK | 10,61% | 6,32% | 5,52% | -6,25% | -2,95% | | | | | | | |
| ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI | 27.876.490,32 | 4,81% | | 468.496.918,04 | 5,95% | OK | OK | OK | 9,92% | 10,19% | 33,13% | 15,13% | 28,45% | | | | | | | |
| Fundos de Índices de Ações | 5.161.177,98 | 0,89% | 2,00% | | | Art. 8o, Inciso II | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA | 5.161.177,98 | 0,89% | | 24.907.720,70 | 20,72% | OK | OK | OK | 11,14% | 6,40% | 41,09% | 12,53% | 31,66% | | | | | | | |
| Fundos de Ações | 36.296.426,71 | 6,26% | 15,00% | | | Art. 8o, Inciso III | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| ARX INCOME FI EM ACOES | 13.707.159,47 | 2,37% | | 119.337.989,90 | 11,49% | OK | OK | OK | 13,27% | 7,15% | 35,75% | 15,43% | 25,49% | | | | | | | |
| AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES | 9.544.527,83 | 1,65% | | 121.413.217,90 | 7,86% | OK | OK | OK | 10,21% | 14,01% | 21,87% | 19,93% | 21,36% | | | | | | | |
| CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS | 5.678.540,98 | 0,98% | | 344.654.790,06 | 1,65% | OK | OK | OK | 5,12% | 4,18% | 15,39% | 9,45% | 11,92% | | | | | | | |
| GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA | 3.028.782,72 | 0,52% | | 258.166.548,57 | 1,17% | OK | OK | OK | 9,00% | 4,18% | 1,29% | -10,38% | -4,60% | | | | | | | |
| ITAU ACOES DIVIDENDOS FI | 4.337.415,71 | 0,75% | | 123.094.440,84 | 3,52% | OK | OK | OK | 12,60% | 9,22% | 41,71% | 6,87% | 30,10% | | | | | | | |
| Fundos Multimercados | 2.765.656,19 | 0,48% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso IV | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO | 2.765.656,19 | 0,48% | | 154.732.953,37 | 1,79% | OK | OK | OK | 1,17% | 3,73% | 2,99% | 8,89% | 3,82% | | | | | | | |
| Fundos de Participações | 8.575.859,20 | 1,48% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso V | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP | 536.832,55 | 0,09% | | 241.939.301,96 | 0,22% | OK | OK | OK | -0,15% | -0,38% | 3,91% | 9,69% | 3,47% | | | | | | | |
| BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP | 909.494,17 | 0,16% | | 229.677.599,90 | 0,40% | OK | OK | OK | -25,57% | -33,76% | -36,70% | 24,08% | -36,20% | | | | | | | |
| FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II | 7.129.532,48 | 1,23% | | 50.619.680,64 | 14,08% | OK | OK | OK | 0,29% | -1,32% | -20,08% | -9,18% | -10,33% | | | | | | | |
| Fundos de Investimento Imobiliários | 12.091.495,18 | 2,09% | 5,00% | | | Art. 8o, Inciso VI | | | | | | Alocação: | Enquadrado | | | | | | | |
| DOMO FII | 5.350.000,00 | 0,92% | | 173.542.101,36 | 3,08% | OK | OK | OK | 2,89% | -7,76% | 0,00% | -13,01% | -8,55% | | | | | | | |
| FII RB CAPITAL RENDA II | 6.741.495,18 | 1,16% | | 127.679.840,94 | 5,28% | OK | OK | OK | 4,73% | 5,87% | 23,41% | -6,41% | 5,60% | | | | | | | |
| Disponibilidades Financeiras | 13.377,02 | 0,002% | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

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.