

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

30/06/2016

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	561.787.187,75	100,00%	211,00%															
META ATUARIAL (INPC + 6%)																		
META ATUARIAL (IPCA + 6%)																		
Títulos Públicos	94.075.145,39	16,75%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A												
CARTEIRA PRÓPRIA FFIN2	94.075.145,39	16,75%																
Fundos que contenham somente títulos públicos	158.897.901,84	28,28%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B												
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	10.370.724,75	1,85%		55.788.819,62	18,59%	OK	OK	OK										
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	69.430.458,32	12,36%		5.287.698.861,53	1,31%	OK	OK	OK	1,68%	5,62%	15,24%	16,53%	15,24%					
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	25.648.063,53	4,57%		2.113.723.699,40	1,21%	OK	OK	OK	0,92%	3,26%	8,66%	16,43%	8,66%					
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	53.448.655,24	9,51%		1.535.560.353,00	3,48%	OK	OK	OK	0,90%	3,21%	8,61%	16,44%	8,61%					
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	165.248.471,61	29,41%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A												
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	68.683.545,28	12,23%		1.758.048.467,38	3,91%	OK	OK	OK	0,91%	3,28%	8,75%	16,54%	8,75%					
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	40.955.262,48	7,29%		965.702.846,13	4,24%	OK	OK	OK	1,84%	5,64%	15,68%	16,13%	15,68%					
BRADESCO FI RF IMA B	37.921.178,68	6,75%		1.009.545.222,24	3,76%	OK	OK	OK	1,94%	5,94%	15,75%	15,97%	15,75%					
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	17.688.485,17	3,15%		212.550.351,25	8,32%	OK	OK	OK	0,88%	3,32%	8,79%	16,74%	8,79%					
Fundos de Renda Fixa (Normal)	23.106.890,59	4,11%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A												
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.553.331,72	2,06%		6.049.752.820,82	0,19%	OK	OK	OK	1,18%	3,38%	6,72%	14,11%	6,72%					
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	8.372.404,87	1,49%		185.114.742,85	4,52%	OK	OK	OK	1,22%	3,74%	7,63%	13,23%	7,63%					
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	3.181.154,00	0,57%		8.093.349.562,81	0,04%	OK	OK	OK	1,11%	3,19%	6,29%	13,23%	6,29%					
FIDC	5.721.618,65	1,02%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI												
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.721.618,65	1,02%		314.709.514,22	1,82%	OK	OK	OK	1,34%	3,87%	7,77%	16,37%	7,77%					
FIDC Fechado	160.607,98	0,03%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A												
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	39.907,66	0,01%		931.180,27	4,29%	OK	OK	OK	-68,98%	-82,38%	-81,27%	-83,29%	-81,27%					
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	120.700,32	0,02%		2.426.113,32	4,98%	OK	OK	OK	-1,91%	-	-16,25%	-27,66%	-16,25%					
Fundo Crédito Privado	18.357.962,00	3,27%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B												
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.788.945,00	1,74%		108.215.842,44	9,05%	OK	OK	OK	1,22%	3,30%	7,70%	15,13%	7,70%					
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.569.017,00	1,53%		99.506.440,11	8,61%	OK	OK	OK	1,19%	3,28%	7,65%	15,06%	7,65%					
Fundos de Ações Referenciados	35.563.545,83	6,33%	15,00%			Art. 8o, Inciso I												
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	7.393.045,48	1,32%		35.431.034,04	20,87%	OK	OK	OK	4,99%	4,59%	14,78%	-4,25%	14,78%					
GERACAO FIA PROGRAMADO	2.810.567,93	0,50%		433.709.901,34	0,65%	OK	OK	OK	4,61%	-1,39%	-12,26%	-13,09%	-12,26%					
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	25.359.932,42	4,51%		471.039.649,96	5,38%	OK	OK	OK	5,53%	5,90%	16,86%	2,60%	16,86%					
Fundos de Índices de Ações	4.643.937,62	0,83%	2,00%			Art. 8o, Inciso II												
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.643.937,62	0,83%		21.042.366,26	22,07%	OK	OK	OK	6,03%	3,07%	18,47%	-2,83%	18,47%					
Fundos de Ações	32.794.402,99	5,84%	15,00%			Art. 8o, Inciso III												
ARX INCOME FI EM ACOES	12.101.349,48	2,15%		105.106.570,13	11,51%	OK	OK	OK	6,59%	0,53%	10,78%	-0,48%	10,78%					
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	8.660.540,21	1,54%		106.264.433,09	8,15%	OK	OK	OK	4,71%	8,13%	10,12%	9,37%	10,12%					
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.401.952,43	0,96%		327.867.481,80	1,65%	OK	OK	OK	2,50%	2,50%	6,47%	2,99%	6,47%					
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.778.586,58	0,49%		237.928.148,63	1,17%	OK	OK	OK	3,91%	-3,08%	-12,48%	-15,14%	-12,48%					
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.851.974,29	0,69%		111.413.654,20	3,46%	OK	OK	OK	7,21%	5,05%	15,54%	-5,72%	15,54%					
Fundos Multimercados	2.733.590,11	0,49%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV												
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.733.590,11	0,49%		156.217.900,60	1,75%	OK	OK	OK	1,49%	3,05%	2,62%	10,16%	2,62%					
Fundos de Participações	8.766.842,99	1,56%	5,00%			Art. 8o, Inciso V												
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	537.626,88	0,10%		242.297.286,77	0,22%	OK	OK	OK	-0,08%	4,41%	3,62%	9,05%	3,62%					
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.221.941,28	0,22%		308.580.912,00	0,40%	OK	OK	OK	-10,81%	-	-15,15%	71,35%	-15,15%					
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	7.007.274,83	1,25%		49.751.651,42	14,08%	OK	OK	OK	-6,60%	-1,49%	-10,59%	-9,58%	-10,59%					
Fundos de Investimento Imobiliários	11.669.004,02	2,08%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI												
DOMO FII	5.199.500,00	0,93%		172.395.932,04	3,02%	OK	OK	OK	-11,87%	-10,20%	-11,12%	-17,47%	-11,12%					
FII RB CAPITAL RENDA II	6.469.504,02	1,15%		127.331.488,08	5,08%	OK	OK	OK	-0,66%	2,74%	0,84%	-10,30%	0,84%					
Disponibilidades Financeiras	47.266,13	0,01%																

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.