

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

31/03/2016

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	535.180.875,54	100,00%	211,00%																
META ATUARIAL (INPC + 6%)																			
META ATUARIAL (IPCA + 6%)																			
Títulos Públicos	91.452.496,46	17,09%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A													
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	91.452.496,46	17,09%																	
Fundos que contenham somente títulos públicos	149.746.353,67	27,98%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B													
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	5.104.696,09	0,95%			46.988.640,73	10,86%	OK	OK	OK	4,80%	9,11%	14,95%	15,77%	9,11%					
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	67.106.814,64	12,54%			4.727.983.554,74	1,42%	OK	OK	OK	0,73%	5,24%	10,60%	16,05%	5,24%					
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	24.851.352,26	4,64%			1.961.009.424,33	1,27%	OK	OK	OK	0,72%	5,24%	10,62%	16,05%	5,24%					
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	52.683.490,68	9,84%			1.334.639.183,52	3,95%	OK	OK	OK	0,74%	5,30%	10,74%	16,35%	5,30%					
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e ID&A	153.787.740,16	28,74%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A													
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	38.767.022,72	7,24%			906.306.624,70	4,28%	OK	OK	OK	5,16%	9,50%	15,02%	15,22%	9,50%					
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	64.957.979,96	12,14%			1.609.080.196,25	4,04%	OK	OK	OK	0,75%	5,29%	10,66%	16,12%	5,29%					
BRADESCO FI RF IMA B	32.942.737,43	6,16%			1.025.977.549,72	3,21%	OK	OK	OK	5,08%	9,26%	14,78%	14,89%	9,26%					
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	17.120.000,05	3,20%			223.310.227,62	7,67%	OK	OK	OK	0,72%	5,30%	10,74%	15,86%	5,30%					
Fundos de Renda Fixa (Normal)	24.380.928,14	4,56%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A													
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.175.392,79	2,09%			6.402.341.873,63	0,17%	OK	OK	OK	1,15%	3,23%	6,69%	13,76%	3,23%					
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	8.070.395,44	1,51%			136.677.951,76	5,90%	OK	OK	OK	1,28%	3,75%	7,14%	12,64%	3,75%					
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	5.135.139,91	0,96%			7.101.944.835,62	0,07%	OK	OK	OK	1,07%	3,01%	6,27%	12,87%	3,01%					
FIDC	5.508.269,83	1,03%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI													
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	5.508.269,83	1,03%			303.439.144,76	1,82%	OK	OK	OK	1,34%	3,75%	7,77%	15,93%	3,75%					
FIDC Fechado	360.322,29	0,07%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A													
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	226.488,96	0,04%			5.284.751,67	4,29%	OK	OK	OK	-1,44%	6,31%	1,11%	-8,57%	6,31%					
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	133.833,33	0,03%			2.690.090,80	4,98%	OK	OK	OK	-1,74%	-7,09%	-17,47%	-17,81%	-7,09%					
Fundo Crédito Privado	17.773.743,00	3,32%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B													
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	9.476.535,00	1,77%			104.762.152,67	9,05%	OK	OK	OK	1,34%	4,26%	8,22%	15,84%	4,26%					
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	8.297.208,00	1,55%			96.350.101,56	8,61%	OK	OK	OK	1,28%	4,23%	8,32%	15,75%	4,23%					
Fundos de Ações Referenciados	33.866.836,74	6,33%	15,00%			Art. 8o, Inciso I													
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.068.617,86	1,32%			36.292.129,14	19,48%	OK	OK	OK	12,51%	9,75%	6,54%	-4,39%	9,75%					
GERACAO FIA PROGRAMADO	2.850.184,40	0,53%			442.237.448,45	0,64%	OK	OK	OK	-5,29%	-11,02%	-10,13%	-8,42%	-11,02%					
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	23.948.034,48	4,47%			451.203.118,83	5,31%	OK	OK	OK	9,81%	10,35%	7,77%	-1,59%	10,35%					
Fundos de Índices de Ações	4.505.734,95	0,84%	2,00%			Art. 8o, Inciso II													
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.505.734,95	0,84%			19.998.510,63	22,53%	OK	OK	OK	16,58%	14,94%	10,66%	-2,65%	14,94%					
Fundos de Ações	31.850.723,66	5,95%	15,00%			Art. 8o, Inciso III													
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.866.931,59	0,54%			247.506.436,08	1,16%	OK	OK	OK	-6,29%	-9,70%	-10,45%	-8,87%	-9,70%					
ARX INCOME FI EM ACOES	12.037.652,68	2,25%			111.519.697,78	10,79%	OK	OK	OK	11,69%	10,20%	6,43%	0,62%	10,20%					
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.270.272,18	0,98%			319.875.281,83	1,65%	OK	OK	OK	3,90%	3,87%	10,60%	1,68%	3,87%					
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	3.666.831,76	0,69%			110.919.824,29	3,31%	OK	OK	OK	14,06%	9,99%	6,05%	-11,12%	9,99%					
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	8.009.035,45	1,50%			87.032.302,52	9,20%	OK	OK	OK	1,43%	1,83%	2,45%	-0,71%	1,83%					
Fundos Multimercados	2.652.801,91	0,50%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV													
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.652.801,91	0,50%			183.332.402,36	1,45%	OK	OK	OK	-1,35%	-0,42%	1,89%	9,74%	-0,42%					
Fundos de Participações	7.170.490,21	1,34%	5,00%			Art. 8o, Inciso V													
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	381.971,64	0,07%			172.558.864,79	0,22%	OK	OK	OK	0,08%	-0,75%	-2,02%	2,48%	-0,75%					
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.375.439,28	0,26%			347.344.272,60	0,40%	OK	OK	OK	-4,11%	-4,47%	82,31%	57,31%	-4,47%					
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	5.413.079,29	1,01%			38.432.862,85	14,08%	OK	OK	OK	6,57%	-9,23%	-7,55%	-9,14%	-9,23%					
Fundos de Investimento Imobiliários	12.104.080,50	2,26%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI													
DOMO FI	5.790.000,00	1,08%			171.183.406,46	3,38%	OK	OK	OK	-0,17%	-1,03%	11,35%	-5,08%	-1,03%					
FI RB CAPITAL RENDA II	6.314.080,50	1,18%			126.572.215,97	4,99%	OK	OK	OK	14,04%	-1,85%	-8,44%	-12,03%	-1,85%					
Disponibilidades Financeiras	20.354,02	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.