

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

30/11/2016

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	605.662.796,46	100,00%	211,00%												
META ATUARIAL (INPC + 6%)										-1,37%	2,39%	8,02%	19,81%	17,68%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,56%	1,79%	4,76%	13,83%	12,27%	
										0,67%	2,00%	4,85%	13,41%	11,78%	
Títulos Públicos	95.423.788,01	15,76%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A							Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	95.423.788,01	15,76%								-0,83%	1,14%	6,26%	20,49%	18,67%	
Fundos que contenham somente títulos públicos	176.728.897,39	29,18%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B							Alocação:	Enquadrado	
SAFRA IMA FIC FI RF	8.313.280,38	1,37%		318.867.440,51	2,61%	OK	OK	OK	-1,26%	0,91%	6,10%	21,09%	19,20%		
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	11.835.575,30	1,95%		64.803.699,90	18,26%	OK	OK	OK	-1,28%	1,31%	6,37%	22,22%	20,56%		
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	2.647.672,78	0,44%		1.347.018.598,38	0,20%	OK	OK	OK	0,27%	3,54%	8,09%	21,70%	21,07%		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	92.074.591,44	15,20%		5.723.242.514,74	1,61%	OK	OK	OK	0,38%	2,25%	5,53%	15,95%	13,63%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	5.969.627,69	0,99%		2.052.041.937,49	0,29%	OK	OK	OK	0,37%	2,18%	5,42%	15,84%	13,48%		
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	55.888.149,80	9,23%		1.584.955.687,69	3,53%	OK	OK	OK	0,39%	2,23%	5,53%	16,08%	13,69%		
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	164.455.937,99	27,15%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A							Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	57.691.556,69	9,53%		2.054.584.718,81	2,81%	OK	OK	OK	0,38%	2,23%	5,54%	16,09%	13,73%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	43.606.443,47	7,20%		1.117.652.616,05	3,90%	OK	OK	OK	-1,21%	1,06%	6,49%	22,78%	20,97%		
BRADESCO FI RF IMA B	39.646.056,08	6,55%		1.246.063.372,24	3,18%	OK	OK	OK	-1,27%	1,09%	6,58%	22,74%	21,01%		
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	23.511.881,75	3,88%		280.516.200,35	8,38%	OK	OK	OK	0,32%	2,23%	5,44%	16,12%	13,71%		
Fundos de Renda Fixa (Normal)	49.463.928,79	8,17%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A							Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	12.232.624,29	2,02%		6.740.519.275,14	0,18%	OK	OK	OK	1,12%	3,43%	7,13%	14,31%	12,99%		
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	22.501.833,34	3,72%		1.204.251.368,16	1,87%	OK	OK	OK	-0,23%	2,59%	7,38%	20,12%	18,96%		
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	11.703.682,97	1,93%		212.996.505,97	5,49%	OK	OK	OK	-0,19%	1,66%	5,52%	13,65%	12,21%		
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	3.025.788,19	0,50%		8.712.734.548,18	0,03%	OK	OK	OK	0,99%	3,06%	6,50%	13,18%	11,96%		
FIDC	6.094.110,66	1,01%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI							Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	6.094.110,66	1,01%		331.616.221,85	1,84%	OK	OK	OK	1,19%	3,72%	7,93%	16,32%	14,78%		
FIDC Fechado	158.718,31	0,03%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A							Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	37.661,40	0,01%		878.767,49	4,29%	OK	OK	OK	-22,82%	371,22%	518,30%	1142,74%	1131,01%		
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	121.056,91	0,02%		2.433.280,88	4,98%	OK	OK	OK	-2,54%	20,76%	-1,62%	-18,82%	-15,96%		
Fundo Crédito Privado			5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B							Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	42.704.167,41	7,05%	15,00%			Art. 8o, Inciso I							Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	8.856.679,65	1,46%		37.728.312,56	23,47%	OK	OK	OK	-4,45%	6,33%	25,78%	35,02%	37,51%		
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.305.361,82	0,88%		517.941.687,49	1,02%	OK	OK	OK	-6,79%	5,81%	23,44%	2,35%	3,54%		
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	28.542.125,94	4,71%		488.574.057,83	5,84%	OK	OK	OK	-6,07%	2,45%	18,77%	28,70%	31,52%		
Fundos de Índices de Ações	5.572.958,45	0,92%	2,00%			Art. 8o, Inciso II							Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.572.958,45	0,92%		25.126.586,01	22,18%	OK	OK	OK	-4,36%	7,13%	27,24%	36,44%	42,17%		
Fundos de Ações	42.163.901,53	6,96%	15,00%			Art. 8o, Inciso III							Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.182.844,83	2,84%		129.879.540,84	13,23%	OK	OK	OK	-5,80%	6,22%	33,40%	34,67%	38,65%		
AZ QUEST ACOES FC FIA	1.961.502,32	0,32%		127.088.441,06	1,54%	OK	OK	OK	-7,14%	3,57%	24,49%	23,39%	28,25%		
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	9.235.390,00	1,52%		137.878.418,19	6,70%	OK	OK	OK	-8,59%	-1,32%	11,66%	12,59%	17,43%		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.731.993,04	0,95%		347.898.932,29	1,65%	OK	OK	OK	-6,08%	0,07%	8,76%	13,10%	12,97%		
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.055.210,71	0,50%		260.265.006,66	1,17%	OK	OK	OK	-10,97%	-0,74%	14,25%	-6,76%	-3,77%		
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.996.960,63	0,83%		135.495.675,31	3,69%	OK	OK	OK	-2,36%	13,67%	39,08%	46,42%	49,89%		
Fundos Multimercados	2.890.930,37	0,48%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV							Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.890.930,37	0,48%		137.518.113,11	2,10%	OK	OK	OK	0,45%	3,62%	7,33%	10,02%	8,52%		
Fundos de Participações	7.724.004,77	1,28%	5,00%			Art. 8o, Inciso V							Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	503.729,97	0,08%		227.020.656,87	0,22%	OK	OK	OK	-0,09%	-0,28%	-6,38%	-3,35%	-2,91%		
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	834.044,19	0,14%		211.381.563,10	0,39%	OK	OK	OK	-0,53%	-1,61%	-13,50%	105,62%	-17,71%		
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.386.230,61	1,05%		45.342.237,32	14,08%	OK	OK	OK	-15,04%	-11,13%	-16,64%	-20,03%	-20,19%		
Fundos de Investimento Imobiliários	12.269.779,00	2,03%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI							Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	5.470.000,00	0,90%		178.874.554,55	3,06%	OK	OK	OK	-11,77%	4,79%	-7,29%	13,96%	-6,50%		
FII RB CAPITAL RENDA II	6.799.779,00	1,12%		124.942.769,73	5,44%	OK	OK	OK	-2,96%	-2,40%	-1,56%	0,75%	-0,34%		
Disponibilidades Financeiras	11.673,78	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.