

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV FFIN2**

**31/10/2016**

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>611.500.364,67</b>	<b>100,00%</b>	<b>211,00%</b>							<b>2,29%</b>	<b>4,88%</b>	<b>8,69%</b>	<b>22,07%</b>	<b>19,31%</b>
<b>META ATUARIAL ( INPC + 6%)</b>										<b>0,66%</b>	<b>2,04%</b>	<b>5,71%</b>	<b>15,02%</b>	<b>11,65%</b>
<b>META ATUARIAL ( IPCA + 6%)</b>										<b>0,75%</b>	<b>2,26%</b>	<b>5,48%</b>	<b>14,35%</b>	<b>11,04%</b>
<b>Títulos Públicos</b>	<b>98.963.051,26</b>	<b>16,18%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	98.963.051,26	16,18%								0,45%	3,26%	4,47%	19,11%	19,66%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>172.577.103,45</b>	<b>28,22%</b>	<b>50,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
SAFRA IMA FIC FI RF	7.240.896,12	1,18%		321.890.728,93	2,26%	OK	OK	OK	0,63%	3,01%	7,30%	23,86%	20,72%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	91.728.208,87	15,00%		6.009.040.311,61	1,53%	OK	OK	OK	0,46%	2,95%	5,95%	16,15%	13,20%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	55.671.101,95	9,10%		1.729.688.385,31	3,22%	OK	OK	OK	0,44%	2,95%	5,94%	16,24%	13,25%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	5.947.780,33	0,97%		2.116.249.348,57	0,28%	OK	OK	OK	0,43%	2,89%	5,84%	16,01%	13,06%	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	11.989.116,18	1,96%		70.326.053,70	17,05%	OK	OK	OK	0,86%	3,32%	7,66%	25,74%	22,13%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa</b>	<b>164.415.106,64</b>	<b>26,89%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	43.351.416,01	7,09%		1.192.314.678,43	3,64%	OK	OK	OK	0,65%	3,31%	7,64%	25,55%	22,45%	
BRADESCO FI RF IMA B	40.154.544,78	6,57%		1.244.532.604,98	3,23%	OK	OK	OK	0,70%	3,33%	7,78%	25,60%	22,56%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	57.471.169,90	9,40%		2.233.696.690,00	2,57%	OK	OK	OK	0,44%	2,98%	5,96%	16,25%	13,30%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	23.437.975,95	3,83%		333.087.160,48	7,04%	OK	OK	OK	0,50%	2,99%	5,89%	16,38%	13,35%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>48.130.155,84</b>	<b>7,87%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	12.096.857,16	1,98%		6.635.521.198,49	0,18%	OK	OK	OK	1,17%	3,53%	7,13%	14,23%	11,74%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	22.553.273,31	3,69%		1.202.923.288,33	1,87%	OK	OK	OK	1,00%	3,76%	7,75%	21,38%	19,23%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	11.725.994,15	1,92%		236.191.411,65	4,96%	OK	OK	OK	0,88%	3,16%	6,51%	14,97%	12,43%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	1.754.031,22	0,29%		8.799.822.529,44	0,02%	OK	OK	OK	0,99%	3,21%	6,56%	13,19%	10,85%	
<b>FIDC</b>	<b>6.022.229,66</b>	<b>0,98%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	6.022.229,66	0,98%		332.382.270,58	1,81%	OK	OK	OK	1,21%	3,93%	8,02%	16,34%	13,43%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>173.006,65</b>	<b>0,03%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	48.796,41	0,01%		1.138.584,89	4,29%	OK	OK	OK	16,41%	694,48%	748,62%	1540,99%	1494,97%	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	124.210,24	0,02%		2.496.663,77	4,98%	OK	OK	OK	-2,43%	9,24%	-5,01%	-21,68%	-13,77%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>			<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>45.348.753,30</b>	<b>7,42%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.269.330,87	1,52%		39.360.562,34	23,55%	OK	OK	OK	9,82%	14,07%	21,20%	38,01%	43,92%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.691.762,20	0,93%		542.930.443,19	1,05%	OK	OK	OK	12,45%	14,45%	21,69%	12,86%	11,08%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	30.387.660,23	4,97%		516.352.020,78	5,89%	OK	OK	OK	9,31%	9,01%	20,12%	35,68%	40,02%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>5.826.713,91</b>	<b>0,95%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.826.713,91	0,95%		29.560.504,67	19,71%	OK	OK	OK	10,92%	12,90%	20,12%	41,33%	48,64%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>45.110.561,59</b>	<b>7,38%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	18.241.616,04	2,98%		139.978.934,94	13,03%	OK	OK	OK	13,21%	17,30%	25,68%	44,69%	47,20%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.112.398,92	0,35%		135.786.457,04	1,56%	OK	OK	OK	11,76%	13,40%	23,41%	31,54%	38,12%	
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.103.778,19	1,65%		150.000.572,63	6,74%	OK	OK	OK	9,53%	5,86%	20,69%	24,45%	28,47%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.103.382,69	1,00%		370.440.150,81	1,65%	OK	OK	OK	6,54%	7,48%	11,97%	22,88%	20,29%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.431.689,48	0,56%		289.293.668,81	1,07%	OK	OK	OK	10,46%	13,30%	18,04%	7,86%	8,09%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.117.696,27	0,84%		137.711.235,09	3,72%	OK	OK	OK	17,46%	17,99%	28,87%	40,71%	53,51%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>2.877.989,00</b>	<b>0,47%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.877.989,00	0,47%		141.321.594,44	2,04%	OK	OK	OK	2,32%	4,06%	7,95%	11,19%	8,04%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>8.862.748,35</b>	<b>1,45%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	504.186,27	0,08%		227.226.304,46	0,22%	OK	OK	OK	-0,09%	-6,08%	-6,44%	-3,66%	-2,82%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	841.530,07	0,14%		212.514.395,30	0,40%	OK	OK	OK	-0,52%	-1,62%	-13,23%	105,36%	-17,27%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	7.517.032,01	1,23%		53.370.927,20	14,08%	OK	OK	OK	4,33%	4,75%	3,38%	-5,88%	-6,06%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>13.191.899,74</b>	<b>2,16%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	6.200.000,00	1,01%		177.972.408,12	3,48%	OK	OK	OK	0,00%	15,89%	6,90%	26,02%	5,98%	
FII RB CAPITAL RENDA II	6.991.899,74	1,14%		128.758.462,84	5,43%	OK	OK	OK	7,01%	12,68%	32,93%	49,69%	44,81%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>1.045,28</b>	<b>0,000%</b>												

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.