

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

30/09/2016

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	597.362.914,16	100,00%	211,00%							1,48%	5,42%	9,18%	21,68%	16,64%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,57%	2,52%	6,21%	15,70%	10,92%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,57%	2,53%	5,85%	14,98%	10,22%
Títulos Públicos	98.524.676,47	16,49%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	98.524.676,47	16,49%								1,53%	4,75%	7,80%	21,76%	19,13%
Fundos que contenham somente títulos públicos	168.770.372,07	28,25%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	10.896.272,13	1,82%		65.283.775,02	16,69%	OK	OK	OK	1,75%	5,07%	10,97%	27,56%	21,08%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	91.311.899,91	15,29%		6.082.965.267,18	1,50%	OK	OK	OK	1,40%	3,70%	7,08%	18,43%	12,68%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	5.922.395,45	0,99%		2.171.390.486,84	0,27%	OK	OK	OK	1,38%	3,65%	6,98%	18,34%	12,58%	
SAFRA IMA FIC FI RF	5.212.043,31	0,87%		277.963.130,60	1,88%	OK	OK	OK	1,55%	4,90%	10,37%	25,86%	19,96%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	55.427.761,27	9,28%		1.683.893.135,40	3,29%	OK	OK	OK	1,39%	3,70%	7,08%	18,58%	12,76%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa	168.964.160,52	28,29%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	67.679.677,10	11,33%		2.234.777.780,68	3,03%	OK	OK	OK	1,39%	3,73%	7,13%	18,55%	12,80%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	43.073.004,58	7,21%		1.169.761.031,60	3,68%	OK	OK	OK	1,64%	5,17%	11,11%	27,79%	21,66%	
BRADESCO FI RF IMA B	39.873.492,78	6,67%		1.191.572.422,21	3,35%	OK	OK	OK	1,67%	5,15%	11,39%	27,86%	21,70%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	18.337.986,06	3,07%		314.252.368,54	5,84%	OK	OK	OK	1,40%	3,67%	7,11%	18,62%	12,79%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	49.112.111,62	8,22%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	11.956.543,31	2,00%		6.698.513.271,76	0,18%	OK	OK	OK	1,10%	3,49%	6,99%	14,15%	10,44%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	20.842.374,11	3,49%		1.151.542.145,17	1,81%	OK	OK	OK	1,81%	4,46%	10,29%	21,56%	18,05%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	8.668.703,47	1,45%		230.568.636,24	3,76%	OK	OK	OK	0,97%	3,54%	7,41%	15,08%	11,44%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	7.644.490,73	1,28%		8.782.612.732,17	0,09%	OK	OK	OK	1,04%	3,27%	6,56%	13,24%	9,77%	
FIDC	5.950.422,87	1,00%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	5.950.422,87	1,00%		323.496.272,18	1,84%	OK	OK	OK	1,27%	4,00%	8,03%	16,42%	12,08%	
FIDC Fechado	312.600,22	0,05%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	127.307,22	0,02%		2.558.913,90	4,98%	OK	OK	OK	27,00%	5,47%	-4,88%	-21,49%	-11,62%	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	185.293,00	0,03%		4.323.511,01	4,29%	OK	OK	OK	306,19%	364,30%	-18,19%	-17,28%	-13,03%	
Fundo Crédito Privado			5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	39.404.187,25	6,60%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	8.440.288,02	1,41%		35.840.179,59	23,55%	OK	OK	OK	1,33%	14,17%	19,41%	27,21%	31,04%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.164.086,79	0,53%		489.143.733,39	0,65%	OK	OK	OK	0,95%	12,58%	11,01%	-0,23%	-1,22%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	27.799.812,44	4,65%		467.298.233,20	5,95%	OK	OK	OK	-0,22%	9,62%	16,08%	25,10%	28,10%	
Fundos de Índices de Ações	5.253.049,64	0,88%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.253.049,64	0,88%		25.704.547,88	20,44%	OK	OK	OK	0,98%	13,12%	16,59%	29,01%	34,00%	
Fundos de Ações	36.619.871,75	6,13%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	14.202.456,77	2,38%		124.516.162,62	11,41%	OK	OK	OK	-0,39%	17,36%	17,98%	25,57%	30,02%	
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	9.224.837,30	1,54%		134.439.122,47	6,86%	OK	OK	OK	-1,43%	6,52%	15,18%	18,00%	17,29%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.728.739,00	0,96%		347.701.453,38	1,65%	OK	OK	OK	0,02%	6,05%	8,70%	20,22%	12,91%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.106.708,82	0,52%		278.181.358,88	1,12%	OK	OK	OK	0,93%	11,81%	8,36%	-2,96%	-2,15%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.357.129,86	0,73%		121.326.928,70	3,59%	OK	OK	OK	-0,89%	13,11%	18,83%	26,01%	30,70%	
Fundos Multimercados	2.812.825,31	0,47%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.812.825,31	0,47%		146.381.862,98	1,92%	OK	OK	OK	0,82%	2,90%	6,03%	8,04%	5,59%	
Fundos de Participações	8.555.853,58	1,43%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	504.652,66	0,08%		227.436.492,19	0,22%	OK	OK	OK	-0,10%	-6,13%	-2,00%	-3,98%	-2,73%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	845.970,70	0,14%		213.635.806,00	0,40%	OK	OK	OK	-0,56%	-1,99%	-12,93%	58,72%	-16,83%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	7.205.230,22	1,21%		51.157.134,52	14,08%	OK	OK	OK	0,27%	0,70%	-0,80%	-8,29%	-9,96%	
Fundos de Investimento Imobiliários	13.071.014,78	2,19%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	6.200.000,00	1,04%		175.308.174,56	3,54%	OK	OK	OK	18,77%	19,24%	7,08%	19,23%	5,98%	
FII RB CAPITAL RENDA II	6.871.014,78	1,15%		128.022.571,77	5,37%	OK	OK	OK	-1,43%	6,41%	9,32%	0,09%	7,30%	
Disponibilidades Financeiras	11.768,08	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.