

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

28/04/2017

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	
RF	542.424.317,35	81,78%	162,00%							0,16%	4,04%	8,72%	15,51%	5,59%
RV	120.803.481,88	18,21%	41,00%							0,54%	1,64%	-0,22%	18,56%	8,14%
CONSOLIDADO	663.240.653,42	100,00%	211,00%							0,23%	3,61%	7,24%	16,56%	6,19%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,50%	2,00%	4,17%	10,20%	2,95%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,56%	2,08%	4,50%	10,30%	2,99%
Títulos Públicos	125.916.848,11	18,99%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	125.916.848,11	18,99%								-0,49%	4,23%	8,22%	13,06%	5,87%
Fundos que contenham somente títulos públicos	203.587.294,01	30,70%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	24.194.349,16	3,65%		4.888.848.685,76	0,49%	OK	OK	OK	0,50%	4,03%	8,65%	17,43%	6,42%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	57.442.977,08	8,66%		2.954.876.504,25	1,94%	OK	OK	OK	0,47%	3,98%	8,60%	17,47%	6,38%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	44.769.764,63	6,75%		6.002.868.089,38	0,75%	OK	OK	OK	0,70%	3,59%	6,62%	12,96%	4,77%	
GF FC FI RF IMA B	12.984.006,51	1,96%		101.160.906,82	12,84%	OK	OK	OK	-0,26%	4,69%	8,30%	16,59%	6,68%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.335.298,58	0,96%		1.985.311.997,03	0,32%	OK	OK	OK	0,68%	3,54%	6,52%	12,74%	4,70%	
SAFRA IMA FIC FI RF	9.097.187,11	1,37%		445.606.956,10	2,04%	OK	OK	OK	-0,27%	4,73%	8,05%	15,95%	6,50%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	48.763.710,94	7,35%		1.256.721.602,79	3,88%	OK	OK	OK	0,70%	3,60%	6,64%	12,98%	4,78%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	146.449.069,74	22,08%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	30.036.862,36	4,53%		2.024.939.500,31	1,48%	OK	OK	OK	0,70%	3,60%	6,61%	12,97%	4,78%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	47.819.896,65	7,21%		1.255.696.969,80	3,81%	OK	OK	OK	-0,35%	4,61%	8,34%	16,62%	6,59%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	43.559.703,47	6,57%		1.643.582.236,81	2,65%	OK	OK	OK	-0,39%	4,65%	8,48%	16,92%	6,67%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	25.032.607,26	3,77%		271.497.509,28	9,22%	OK	OK	OK	0,66%	3,76%	6,80%	13,09%	4,97%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	59.889.964,55	9,03%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.549.560,67	1,89%		182.490.790,21	6,88%	OK	OK	OK	0,79%	4,57%	7,02%	13,99%	5,77%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.862.201,32	1,94%		8.466.633.870,60	0,15%	OK	OK	OK	0,91%	2,86%	6,33%	13,90%	3,98%	
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	24.433.041,23	3,68%		1.382.253.366,36	1,77%	OK	OK	OK	0,21%	4,12%	8,33%	16,73%	6,33%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	10.045.161,33	1,51%		8.627.554.708,01	0,12%	OK	OK	OK	0,74%	2,56%	5,75%	12,69%	3,62%	
FIDC	6.446.756,14	0,97%	1,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6.446.756,14	0,97%		394.265.382,01	1,64%	OK	OK	OK	0,91%	3,15%	7,05%	15,63%	4,44%	
FIDC Fechado	134.384,80	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	29.587,90	0,00%		690.385,59	4,29%	OK	OK	OK	-9,05%	-46,19%	-39,36%	414,56%	-93,54%	
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	104.796,90	0,02%		2.106.449,59	4,98%	OK	OK	OK	-3,04%	-8,73%	-15,63%	-19,86%	-10,17%	
Fundo Crédito Privado			5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações Referenciados	45.741.336,00	6,90%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.190.850,46	1,39%		43.702.996,38	21,03%	OK	OK	OK	1,03%	0,12%	-0,85%	20,17%	5,24%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.561.090,87	0,84%		497.098.242,75	1,12%	OK	OK	OK	-1,26%	-2,71%	-2,30%	18,89%	3,35%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	30.989.394,67	4,67%		531.474.958,92	5,83%	OK	OK	OK	1,18%	2,76%	1,98%	22,49%	10,22%	
Fundos de Índices de Ações	5.878.995,85	0,89%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.878.995,85	0,89%		24.181.993,10	24,31%	OK	OK	OK	0,70%	1,13%	0,90%	21,20%	8,40%	
Fundos de Ações	45.763.310,49	6,90%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.848.112,33	2,69%		147.142.584,35	12,13%	OK	OK	OK	0,23%	0,51%	-2,16%	22,97%	8,66%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.052.543,04	0,31%		129.909.989,49	1,58%	OK	OK	OK	1,05%	-0,85%	-2,83%	19,91%	6,53%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	10.954.930,68	1,65%		227.765.780,00	4,81%	OK	OK	OK	1,75%	4,84%	8,42%	30,86%	15,99%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.168.877,23	0,93%		374.415.364,35	1,65%	OK	OK	OK	1,81%	5,23%	1,07%	13,17%	8,20%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.217.488,32	0,49%		245.766.598,42	1,31%	OK	OK	OK	-1,39%	-1,73%	-6,24%	10,67%	3,03%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.521.358,89	0,83%		167.659.619,19	3,29%	OK	OK	OK	-0,46%	4,01%	7,89%	39,03%	11,35%	
Fundos Multimercados	3.034.510,36	0,46%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.034.510,36	0,46%		127.654.213,49	2,38%	OK	OK	OK	0,74%	2,49%	5,44%	13,82%	4,24%	
Fundos de Participações	7.742.974,28	1,17%	3,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	500.994,89	0,08%		225.788.006,95	0,22%	OK	OK	OK	-0,09%	-0,35%	-0,63%	-7,03%	-0,44%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	752.775,43	0,11%		190.100.932,10	0,40%	OK	OK	OK	-0,51%	-5,60%	-5,25%	-17,78%	-4,17%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.489.203,96	0,98%		46.073.348,21	14,08%	OK	OK	OK	0,30%	1,09%	-14,23%	-11,33%	1,21%	
Fundos de Investimento Imobiliários	12.642.354,90	1,91%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.515.000,00	0,68%		166.588.213,24	2,71%	OK	OK	OK	-8,66%	-7,29%	-27,18%	-22,16%	-6,71%	
FII RB CAPITAL RENDA II	8.127.354,90	1,23%		136.734.890,65	5,99%	OK	OK	OK	3,42%	3,98%	18,01%	26,12%	15,24%	
Disponibilidades Financeiras	12.854,19	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.