

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV FFIN2**

**31/08/2017**

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	568.324.213,20	79,97%	162,00%							1,26%	4,95%	5,99%	16,11%	10,38%
RV	142.364.217,72	20,03%	41,00%							5,21%	17,05%	11,36%	24,45%	22,23%
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>710.694.011,87</b>	<b>100,00%</b>	<b>211,00%</b>							<b>2,03%</b>	<b>7,19%</b>	<b>7,06%</b>	<b>17,97%</b>	<b>12,58%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										0,50%	1,35%	3,60%	7,79%	4,28%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										0,72%	1,72%	3,91%	8,55%	4,69%
<b>Títulos Públicos</b>	<b>121.582.667,14</b>	<b>17,11%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	121.582.667,14	17,11%								1,46%	5,49%	5,39%	15,66%	10,95%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>225.713.168,12</b>	<b>31,76%</b>	<b>50,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	26.158.409,73	3,68%		5.019.690.527,82	0,52%	OK	OK	OK	1,04%	4,73%	7,08%	17,74%	11,73%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	67.577.343,07	9,51%		2.824.183.322,38	2,39%	OK	OK	OK	1,01%	4,73%	7,05%	17,80%	11,75%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	50.276.310,81	7,07%		6.296.856.629,93	0,80%	OK	OK	OK	1,24%	4,63%	6,90%	13,72%	9,71%	
GF FC FI RF IMA B	13.423.045,00	1,89%		102.235.718,28	13,13%	OK	OK	OK	1,25%	5,43%	4,25%	14,90%	10,29%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.628.575,16	0,93%		1.872.929.085,37	0,35%	OK	OK	OK	1,22%	4,60%	6,77%	13,46%	9,55%	
SAFRA IMA FIC FI RF	11.972.407,50	1,68%		404.089.458,00	2,96%	OK	OK	OK	1,41%	5,87%	5,08%	14,94%	10,85%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	49.677.076,85	6,99%		1.321.921.132,04	3,76%	OK	OK	OK	1,24%	4,62%	6,86%	13,68%	9,68%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa</b>	<b>154.375.238,33</b>	<b>21,72%</b>	<b>35,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	32.779.476,89	4,61%		1.913.155.812,65	1,71%	OK	OK	OK	1,24%	4,66%	6,94%	13,74%	9,76%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	49.868.747,36	7,02%		1.230.094.705,05	4,05%	OK	OK	OK	1,33%	5,59%	5,01%	15,58%	11,15%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	45.481.370,04	6,40%		1.661.474.640,17	2,74%	OK	OK	OK	1,39%	5,66%	5,12%	15,97%	11,37%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	26.245.644,04	3,69%		307.254.569,12	8,54%	OK	OK	OK	1,33%	4,80%	7,07%	14,11%	10,06%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>59.809.213,62</b>	<b>8,42%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.877.402,88	1,81%		195.501.022,55	6,59%	OK	OK	OK	1,15%	3,75%	5,00%	11,86%	8,53%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.326.475,45	1,88%		11.675.947.076,19	0,11%	OK	OK	OK	0,99%	2,65%	5,65%	12,68%	7,74%	
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	25.307.848,63	3,56%		1.502.261.222,00	1,68%	OK	OK	OK	1,18%	4,75%	5,16%	15,38%	10,13%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.132.136,18	0,86%		7.815.984.089,09	0,08%	OK	OK	OK	0,79%	2,46%	5,29%	11,97%	7,34%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	1.554.260,94	0,22%		6.475.185.535,55	0,02%	OK	OK	OK	0,84%	2,51%	5,42%	12,24%	7,50%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	611.089,54	0,09%		8.805.020.134,49	0,01%	OK	OK	OK	0,76%	2,30%	4,99%	11,36%	6,93%	
<b>FIDC</b>	<b>6.698.074,04</b>	<b>0,94%</b>	<b>1,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6.698.074,04	0,94%		399.312.508,16	1,68%	OK	OK	OK	1,18%	3,63%	7,18%	15,15%	9,60%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>145.851,95</b>	<b>0,02%</b>	<b>1,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	64.794,99	0,01%		1.511.885,73	4,29%	OK	OK	OK	164,33%	134,60%	79,79%	710,72%	-85,86%	
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	81.056,96	0,01%		1.629.269,58	4,98%	OK	OK	OK	-13,42%	-20,10%	-27,20%	-19,14%	-30,52%	
<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>49.194.006,75</b>	<b>6,92%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	10.171.306,09	1,43%		48.752.465,13	20,86%	OK	OK	OK	6,76%	13,28%	7,59%	22,11%	16,47%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.470.906,33	0,77%		370.904.640,17	1,48%	OK	OK	OK	1,62%	4,58%	-5,06%	9,11%	1,68%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	33.551.794,33	4,72%		560.417.787,47	5,99%	OK	OK	OK	6,69%	12,89%	7,50%	20,43%	19,34%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>6.352.893,34</b>	<b>0,89%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	6.352.893,34	0,89%		28.344.960,93	22,41%	OK	OK	OK	7,32%	12,59%	5,99%	22,13%	17,14%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>49.202.832,82</b>	<b>6,92%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	19.339.491,12	2,72%		149.195.327,58	12,96%	OK	OK	OK	9,17%	14,06%	5,61%	19,55%	17,74%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.232.994,21	0,31%		122.733.654,37	1,82%	OK	OK	OK	8,03%	15,41%	5,60%	17,90%	15,90%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	12.450.287,90	1,75%		296.302.977,49	4,20%	OK	OK	OK	8,47%	19,20%	12,93%	33,04%	31,83%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.454.491,34	0,91%		393.089.207,90	1,64%	OK	OK	OK	6,51%	8,22%	5,42%	12,69%	13,21%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.149.970,07	0,44%		130.301.876,23	2,42%	OK	OK	OK	1,27%	3,42%	-5,35%	2,34%	0,86%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.575.598,18	0,78%		159.504.407,99	3,50%	OK	OK	OK	6,23%	10,23%	-2,35%	26,83%	12,44%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>8.334.540,93</b>	<b>1,17%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.126.942,93	0,44%		114.226.944,67	2,74%	OK	OK	OK	0,99%	3,19%	4,45%	12,08%	7,42%	
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	5.207.598,00	0,73%		33.838.974,47	15,39%	OK	OK	OK	1,78%	-	-	-	-	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>15.870.868,03</b>	<b>2,23%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	467.352,40	0,07%		210.626.045,23	0,22%	OK	OK	OK	-6,42%	-6,61%	-6,96%	-7,48%	-7,13%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	732.481,94	0,10%		184.976.305,09	0,40%	OK	OK	OK	-0,75%	-2,06%	-3,82%	-8,80%	-6,76%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.671.033,69	2,06%		104.164.339,30	14,08%	OK	OK	OK	0,00%	126,61%	128,44%	102,85%	128,81%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>13.409.075,85</b>	<b>1,89%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	4.510.000,00	0,63%		160.046.380,86	2,82%	OK	OK	OK	10,00%	10,00%	-13,27%	-1,96%	-6,82%	
FII RB CAPITAL RENDA II	8.899.075,85	1,25%		138.454.849,67	6,43%	OK	OK	OK	-4,02%	0,67%	14,20%	27,08%	26,85%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>5.580,95</b>	<b>0,00%</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.