

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV FFIN2**

**24/02/2017**

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	529.992.421,99	81,21%	162,00%							2,61%	7,45%	9,55%	19,63%	4,14%
RV	122.664.977,58	18,79%	41,00%							3,17%	8,21%	11,76%	35,44%	9,77%
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>652.680.385,74</b>	<b>100,00%</b>	<b>211,00%</b>							<b>2,72%</b>	<b>7,75%</b>	<b>10,37%</b>	<b>22,83%</b>	<b>5,28%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										0,73%	2,28%	4,11%	10,98%	1,64%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										0,82%	2,50%	4,54%	11,04%	1,69%
<b>Títulos Públicos</b>	<b>125.223.196,52</b>	<b>19,19%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	125.223.196,52	19,19%								3,64%	8,51%	9,74%	23,25%	5,28%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>189.505.609,71</b>	<b>29,04%</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	22.431.171,98	3,44%		4.731.281.971,71	0,47%	OK	OK	OK	2,01%	6,23%	9,96%	23,21%	4,35%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	56.368.403,86	8,64%		2.443.034.104,21	2,31%	OK	OK	OK	2,04%	6,28%	10,04%	23,40%	4,39%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	43.856.112,95	6,72%		5.626.003.834,34	0,78%	OK	OK	OK	1,48%	4,05%	6,38%	13,17%	2,63%	
GF FC FI RF IMA B	12.875.696,99	1,97%		81.102.227,99	15,88%	OK	OK	OK	3,82%	8,79%	10,22%	25,97%	5,79%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.208.388,10	0,95%		1.942.005.717,06	0,32%	OK	OK	OK	1,46%	4,00%	6,27%	12,95%	2,60%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	47.765.835,83	7,32%		1.333.978.210,51	3,58%	OK	OK	OK	1,48%	4,06%	6,38%	13,19%	2,64%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa</b>	<b>153.203.365,79</b>	<b>23,47%</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	29.422.200,34	4,51%		1.940.029.510,25	1,52%	OK	OK	OK	1,48%	4,03%	6,35%	13,21%	2,63%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	46.988.920,12	7,20%		1.284.102.751,60	3,66%	OK	OK	OK	3,89%	8,91%	10,06%	26,52%	5,85%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	43.268.097,08	6,63%		1.638.161.922,05	2,64%	OK	OK	OK	3,95%	9,14%	10,32%	27,01%	5,95%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	24.512.965,88	3,76%		258.985.451,60	9,46%	OK	OK	OK	1,60%	4,26%	6,58%	13,40%	2,79%	
SAFRA IMA FIC FI RF	9.011.182,37	1,38%		400.376.378,91	2,25%	OK	OK	OK	3,74%	8,40%	9,38%	24,35%	5,50%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>55.600.412,19</b>	<b>8,52%</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	12.264.305,80	1,88%		172.479.385,98	7,11%	OK	OK	OK	2,20%	4,79%	6,53%	14,79%	3,36%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.613.711,30	1,93%		7.584.324.320,29	0,17%	OK	OK	OK	0,87%	3,12%	6,65%	14,17%	1,98%	
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	24.065.431,11	3,69%		1.361.585.761,94	1,77%	OK	OK	OK	2,55%	6,95%	9,72%	23,39%	4,73%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	6.656.963,98	1,02%		8.666.878.243,14	0,08%	OK	OK	OK	0,81%	2,92%	6,06%	13,06%	1,84%	
<b>FIDC</b>	<b>6.312.454,00</b>	<b>0,97%</b>	<b>1,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	6.312.454,00	0,97%		-		OK	OK	OK	-	-	-	-	-	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>147.383,78</b>	<b>0,02%</b>	<b>1,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC MULTISERIAL BVA MASTER II SENIOR	36.039,11	0,01%		840.914,16	4,29%	OK	OK	OK	-34,46%	-4,31%	350,92%	604,21%	-92,13%	
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	111.344,67	0,02%		2.238.061,74	4,98%	OK	OK	OK	-3,03%	-8,02%	11,07%	-18,25%	-4,55%	
<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>46.427.514,62</b>	<b>7,11%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.454.084,73	1,45%		40.768.413,74	23,19%	OK	OK	OK	2,99%	6,75%	13,50%	50,47%	8,26%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.762.531,07	0,88%		551.302.733,30	1,05%	OK	OK	OK	0,81%	8,62%	14,93%	19,70%	7,10%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	31.210.898,82	4,78%		534.697.877,39	5,84%	OK	OK	OK	3,50%	9,35%	12,03%	43,11%	11,01%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>5.994.087,96</b>	<b>0,92%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.994.087,96	0,92%		27.354.639,74	21,91%	OK	OK	OK	3,11%	7,56%	15,23%	55,08%	10,52%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>46.611.950,13</b>	<b>7,14%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	18.311.931,11	2,81%		144.035.447,38	12,71%	OK	OK	OK	3,13%	6,57%	13,20%	49,76%	11,48%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.114.614,19	0,32%		126.903.358,26	1,67%	OK	OK	OK	2,15%	7,81%	11,65%	40,29%	9,76%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	11.025.119,96	1,69%		176.965.421,54	6,23%	OK	OK	OK	5,52%	19,38%	17,81%	39,63%	16,74%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.122.684,96	0,94%		371.611.684,93	1,65%	OK	OK	OK	4,44%	6,82%	6,89%	20,71%	7,39%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.328.014,63	0,51%		277.183.886,32	1,20%	OK	OK	OK	1,64%	8,93%	8,12%	8,78%	6,56%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.709.585,28	0,87%		152.600.191,72	3,74%	OK	OK	OK	7,56%	14,26%	29,88%	77,60%	15,14%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>2.993.761,82</b>	<b>0,46%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.993.761,82	0,46%		131.923.759,06	2,27%	OK	OK	OK	1,11%	3,56%	7,31%	11,33%	2,84%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>7.644.900,45</b>	<b>1,17%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	502.327,90	0,08%		226.388.765,57	0,22%	OK	OK	OK	-0,09%	-0,28%	-0,56%	-2,38%	-0,18%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	761.597,62	0,12%		192.328.987,20	0,40%	OK	OK	OK	-14,12%	-13,34%	-14,73%	-28,41%	-12,82%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.380.974,93	0,98%		45.304.922,04	14,08%	OK	OK	OK	0,05%	-0,08%	-11,20%	-6,38%	0,16%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>12.992.762,60</b>	<b>1,99%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	5.200.000,00	0,80%		164.159.583,26	3,17%	OK	OK	OK	6,77%	-4,94%	-0,38%	-10,34%	7,44%	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.792.762,60	1,19%		135.826.332,85	5,74%	OK	OK	OK	0,28%	13,20%	11,28%	40,74%	11,08%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>22.986,17</b>	<b>0,004%</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.