

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV FF2**

**31/01/2017**

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	515.667.013,06	81,26%	162,00%							1,49%	4,49%	7,92%	18,67%	1,49%
RV	118.906.784,81	18,74%	41,00%							6,39%	-1,83%	9,19%	34,67%	6,39%
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>634.580.311,36</b>	<b>100,00%</b>	<b>211,00%</b>							<b>2,49%</b>	<b>3,50%</b>	<b>8,56%</b>	<b>21,87%</b>	<b>2,49%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										0,91%	2,11%	4,19%	11,76%	0,91%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										0,87%	2,34%	4,66%	11,68%	0,87%
<b>Títulos Públicos</b>	<b>120.825.904,94</b>	<b>19,04%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA FF2	120.825.904,94	19,04%								1,58%	3,83%	7,22%	21,94%	1,58%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>174.250.875,23</b>	<b>27,46%</b>	<b>50,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
SAFRA IMA FIC FI RF	8.686.446,10	1,37%		371.329.753,80	2,34%	OK	OK	OK	1,70%	3,17%	6,28%	22,44%	1,70%	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	1.513.862,80	0,24%		4.027.807.080,47	0,04%	OK	OK	OK	2,29%	4,44%	8,85%	22,68%	2,29%	
BRASIL PLURAL JURO REAL IMA B FI RF LP	12.402.257,66	1,95%		70.833.796,00	17,51%	OK	OK	OK	1,90%	3,45%	6,88%	24,17%	1,90%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	55.243.191,58	8,71%		1.828.407.855,08	3,02%	OK	OK	OK	2,31%	4,44%	8,91%	22,88%	2,31%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	43.217.512,74	6,81%		5.503.989.684,97	0,79%	OK	OK	OK	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	1,14%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.118.852,54	0,96%		1.926.319.580,43	0,32%	OK	OK	OK	1,12%	2,88%	5,85%	13,00%	1,12%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	47.068.751,81	7,42%		1.346.983.945,44	3,49%	OK	OK	OK	1,14%	2,94%	5,97%	13,23%	1,14%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>160.380.107,41</b>	<b>25,27%</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	48.918.211,97	7,71%		2.055.840.281,62	2,38%	OK	OK	OK	1,14%	2,91%	5,97%	13,25%	1,14%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	45.712.767,48	7,20%		1.176.665.634,64	3,88%	OK	OK	OK	1,89%	3,56%	6,99%	24,48%	1,89%	
BRADESCO FI RF IMA B	41.622.832,14	6,56%		1.502.122.003,24	2,77%	OK	OK	OK	1,92%	3,66%	7,11%	24,84%	1,92%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	24.126.295,82	3,80%		277.234.044,20	8,70%	OK	OK	OK	1,17%	2,94%	6,02%	13,31%	1,17%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>53.790.178,33</b>	<b>8,48%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	12.504.571,28	1,97%		7.240.763.781,97	0,17%	OK	OK	OK	1,09%	3,37%	7,02%	14,30%	1,09%	
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	23.465.965,62	3,70%		1.288.512.627,24	1,82%	OK	OK	OK	2,12%	4,05%	7,96%	22,33%	2,12%	
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	12.000.864,94	1,89%		176.392.836,78	6,80%	OK	OK	OK	1,14%	2,34%	5,57%	13,28%	1,14%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	5.818.776,49	0,92%		8.694.023.011,19	0,07%	OK	OK	OK	1,03%	3,11%	6,41%	13,18%	1,03%	
<b>FIDC</b>	<b>6.250.129,38</b>	<b>0,98%</b>	<b>1,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	6.250.129,38	0,98%		358.170.573,68	1,75%	OK	OK	OK	1,25%	3,78%	7,86%	16,31%	1,25%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>169.817,77</b>	<b>0,03%</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	54.990,90	0,01%		1.283.123,19	4,29%	OK	OK	OK	-88,00%	12,69%	795,34%	1683,13%	-88,00%	
FIDC TRENBANK MULTISERIAL 2 SEN	114.826,87	0,02%		2.308.055,11	4,98%	OK	OK	OK	-1,57%	-7,55%	0,99%	-17,23%	-1,57%	
<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>45.052.473,03</b>	<b>7,10%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.179.731,27	1,45%		39.522.940,33	23,23%	OK	OK	OK	5,12%	-0,97%	12,96%	53,59%	5,12%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.715.957,61	0,90%		549.044.907,26	1,04%	OK	OK	OK	6,23%	0,43%	14,94%	21,28%	6,23%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	30.156.784,15	4,75%		515.341.765,80	5,85%	OK	OK	OK	7,26%	-0,76%	8,18%	44,02%	7,26%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>5.813.375,05</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	5.813.375,05	0,92%		24.642.536,73	23,59%	OK	OK	OK	7,19%	-0,23%	12,64%	58,92%	7,19%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>44.720.825,13</b>	<b>7,05%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.756.816,16	2,80%		134.572.419,13	13,19%	OK	OK	OK	8,10%	-2,66%	14,19%	55,00%	8,10%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.070.066,90	0,33%		118.880.421,53	1,74%	OK	OK	OK	7,44%	-2,00%	11,12%	39,89%	7,44%	
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	10.448.847,51	1,65%		159.796.859,06	6,54%	OK	OK	OK	10,64%	3,42%	9,47%	33,42%	10,64%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.862.497,79	0,92%		355.819.825,11	1,65%	OK	OK	OK	2,82%	-3,95%	3,24%	19,13%	2,82%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.274.232,70	0,52%		273.707.254,82	1,20%	OK	OK	OK	4,84%	-4,59%	8,10%	9,49%	4,84%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.308.364,07	0,84%		140.081.982,95	3,79%	OK	OK	OK	7,05%	3,73%	22,39%	73,43%	7,05%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>2.960.829,36</b>	<b>0,47%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.960.829,36	0,47%		132.789.906,81	2,23%	OK	OK	OK	1,71%	2,88%	7,06%	10,25%	1,71%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>7.767.555,42</b>	<b>1,22%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	502.758,82	0,08%		226.582.983,92	0,22%	OK	OK	OK	-0,09%	-0,28%	-6,35%	-2,69%	-0,09%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	886.795,07	0,14%		223.945.601,30	0,40%	OK	OK	OK	1,51%	0,37%	-1,25%	-16,77%	1,51%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.378.001,53	1,01%		45.283.810,83	14,08%	OK	OK	OK	0,12%	-15,15%	-11,12%	-28,96%	0,12%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>12.591.726,82</b>	<b>1,98%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	4.870.200,00	0,77%		163.090.578,02	2,99%	OK	OK	OK	0,62%	-21,45%	-8,97%	-8,97%	0,62%	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.721.526,82	1,22%		132.619.714,26	5,82%	OK	OK	OK	10,77%	13,39%	14,39%	41,18%	10,77%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>6.513,49</b>	<b>0,001%</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.