

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FF2

31/07/2017

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	559.522.605,83	80,52%	162,00%							3,07%	3,23%	7,40%	15,91%	9,00%
RV	135.314.593,35	19,47%	41,00%							10,92%	7,44%	9,20%	19,24%	16,18%
CONSOLIDADO	694.848.843,23	100,00%	211,00%							4,51%	4,06%	7,75%	16,79%	10,31%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,66%	1,72%	3,76%	8,15%	4,72%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,73%	1,82%	3,93%	8,82%	4,86%
Títulos Públicos	119.832.276,68	17,25%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA FF2	119.832.276,68	17,25%								3,67%	3,28%	7,65%	15,42%	9,35%
Fundos que contenham somente títulos públicos	220.229.471,05	31,69%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	25.450.737,66	3,66%		5.042.823.951,08	0,50%	OK	OK	OK	2,31%	3,92%	8,10%	17,68%	10,59%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	66.903.634,05	9,63%		2.749.245.325,68	2,43%	OK	OK	OK	2,31%	4,00%	8,14%	17,77%	10,63%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	49.660.694,48	7,15%		6.028.101.250,89	0,82%	OK	OK	OK	2,82%	3,44%	7,15%	13,53%	8,37%	
GF FC FI RF IMA B	13.257.463,92	1,91%		102.368.625,76	12,95%	OK	OK	OK	4,01%	2,11%	6,90%	14,25%	8,93%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.548.941,21	0,94%		1.841.482.113,55	0,36%	OK	OK	OK	2,81%	3,37%	7,03%	13,29%	8,23%	
SAFRA IMA FIC FI RF	9.337.369,28	1,34%		406.845.294,25	2,30%	OK	OK	OK	4,30%	2,64%	7,49%	14,25%	9,32%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	49.070.630,45	7,06%		1.335.400.262,97	3,67%	OK	OK	OK	2,82%	3,40%	7,12%	13,52%	8,34%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDKa	152.350.834,70	21,93%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	32.376.662,14	4,66%		1.804.319.993,14	1,79%	OK	OK	OK	2,85%	3,47%	7,19%	13,59%	8,41%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	49.213.813,28	7,08%		1.170.018.377,76	4,21%	OK	OK	OK	4,01%	2,91%	7,66%	15,18%	9,69%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	44.858.219,53	6,46%		1.668.518.414,62	2,69%	OK	OK	OK	4,06%	2,98%	7,77%	15,43%	9,85%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	25.902.139,75	3,73%		275.619.939,41	9,40%	OK	OK	OK	2,93%	3,47%	7,36%	13,82%	8,62%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	60.356.773,94	8,69%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.731.063,17	1,83%		192.135.077,99	6,63%	OK	OK	OK	1,60%	1,45%	6,08%	12,00%	7,30%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.196.104,33	1,90%		9.674.874.982,91	0,14%	OK	OK	OK	0,81%	2,60%	5,53%	12,94%	6,68%	
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	25.012.575,68	3,60%		1.464.859.405,47	1,71%	OK	OK	OK	2,53%	2,37%	6,59%	15,08%	8,85%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.084.068,74	0,88%		7.964.082.161,14	0,08%	OK	OK	OK	0,80%	2,59%	5,37%	12,42%	6,50%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	2.734.868,75	0,39%		6.203.106.318,52	0,04%	OK	OK	OK	0,80%	2,62%	5,45%	12,67%	6,60%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	598.093,27	0,09%		8.756.513.940,33	0,01%	OK	OK	OK	0,73%	2,41%	5,04%	11,78%	6,12%	
FIDC	6.636.868,92	0,96%	1,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6.636.868,92	0,96%		395.979.662,00	1,68%	OK	OK	OK	1,22%	3,73%	6,99%	15,40%	8,33%	
FIDC Fechado	116.380,54	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	22.755,32	0,00%		530.958,42	4,29%	OK	OK	OK	-8,54%	-	-	-	-	
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	93.625,22	0,01%		1.881.895,54	4,98%	OK	OK	OK	-3,79%	-10,66%	-18,46%	-17,66%	-19,74%	
Fundo Crédito Privado			5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	46.359.729,46	6,67%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.527.107,18	1,37%		45.593.537,25	20,90%	OK	OK	OK	4,28%	3,66%	3,78%	17,24%	9,09%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.383.792,12	0,77%		411.119.680,03	1,31%	OK	OK	OK	2,74%	-3,19%	-5,81%	8,26%	0,06%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	31.448.830,16	4,53%		523.173.803,41	6,01%	OK	OK	OK	4,89%	1,48%	4,28%	12,81%	11,86%	
Fundos de Índices de Ações	5.919.832,39	0,85%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.919.832,39	0,85%		25.727.212,95	23,01%	OK	OK	OK	4,76%	0,69%	1,83%	14,70%	9,16%	
Fundos de Ações	45.679.163,72	6,57%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.715.432,34	2,55%		141.337.116,80	12,53%	OK	OK	OK	4,48%	-0,74%	-0,23%	13,92%	7,85%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.066.958,62	0,30%		112.505.944,25	1,84%	OK	OK	OK	6,61%	0,70%	-0,15%	10,96%	7,28%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	11.477.623,38	1,65%		261.026.210,92	4,40%	OK	OK	OK	10,64%	4,77%	9,85%	20,25%	21,53%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.060.126,63	0,87%		367.814.976,56	1,65%	OK	OK	OK	1,73%	-1,76%	3,37%	6,72%	6,29%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.110.616,41	0,45%		174.311.290,07	1,78%	OK	OK	OK	1,87%	-3,32%	-5,00%	2,70%	-0,40%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.248.406,34	0,76%		154.028.552,79	3,41%	OK	OK	OK	5,08%	-4,94%	-1,13%	21,00%	5,84%	
Fundos Multimercados	8.212.740,49	1,18%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.096.159,49	0,45%		117.318.679,49	2,64%	OK	OK	OK	1,27%	2,03%	4,57%	11,95%	6,36%	
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	5.116.581,00	0,74%		33.247.543,91	15,39%	OK	OK	OK	2,04%	-	-	-	-	
Fundos de Participações	15.908.757,50	2,29%	3,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	499.396,68	0,07%		225.067.740,68	0,22%	OK	OK	OK	-0,11%	-0,32%	-0,67%	-6,97%	-0,76%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	737.990,15	0,11%		186.367.366,52	0,40%	OK	OK	OK	-0,66%	-1,96%	-7,46%	-8,61%	-6,05%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.671.370,67	2,11%		104.166.731,73	14,08%	OK	OK	OK	126,24%	126,09%	128,55%	103,14%	128,82%	
Fundos de Investimento Imobiliários	13.234.369,79	1,90%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.100.000,00	0,59%		160.612.446,65	2,55%	OK	OK	OK	2,50%	-9,19%	-15,81%	-23,36%	-15,29%	
FII RB CAPITAL RENDA II	9.134.369,79	1,31%		137.985.621,11	6,62%	OK	OK	OK	3,49%	13,93%	19,31%	36,48%	32,15%	
Disponibilidades Financeiras	11.644,05	0,00%												

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.