

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

30/06/2017

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	541.768.575,93	81,58%	162,00%							0,56%	0,31%	5,76%	14,25%	5,76%
RV	122.039.701,16	18,38%	41,00%							0,30%	-2,62%	4,74%	16,47%	4,74%
CONSOLIDADO	664.121.718,08	100,00%	211,00%							0,52%	-0,22%	5,55%	14,89%	5,55%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,19%	1,56%	4,04%	8,66%	4,04%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,26%	1,64%	4,10%	9,13%	4,10%
Títulos Públicos	122.173.236,94	18,40%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	122.173.236,94	18,40%								0,29%	-0,86%	5,48%	13,44%	5,48%
Fundos que contenham somente títulos públicos	208.313.433,17	31,37%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	24.629.250,61	3,71%		4.997.389.247,97	0,49%	OK	OK	OK	1,32%	2,08%	8,09%	16,54%	8,09%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	58.394.981,45	8,79%		2.655.605.223,75	2,20%	OK	OK	OK	1,34%	2,13%	8,13%	16,65%	8,13%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	48.297.167,31	7,27%		5.947.290.865,39	0,81%	OK	OK	OK	0,51%	1,30%	5,40%	11,73%	5,40%	
GF FC FI RF IMA B	12.746.761,91	1,92%		97.449.370,09	13,08%	OK	OK	OK	0,11%	-2,08%	4,74%	12,67%	4,74%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.370.189,47	0,96%		1.878.270.179,61	0,34%	OK	OK	OK	0,52%	1,24%	5,28%	11,49%	5,28%	
SAFRA IMA FIC FI RF	8.952.686,37	1,35%		433.236.214,84	2,07%	OK	OK	OK	0,10%	-1,86%	4,81%	12,26%	4,81%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	48.922.396,05	7,37%		1.312.891.511,00	3,73%	OK	OK	OK	0,51%	1,26%	5,37%	11,70%	5,37%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	147.069.826,69	22,15%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	31.479.562,58	4,74%		1.849.394.391,35	1,70%	OK	OK	OK	0,51%	1,30%	5,41%	11,74%	5,41%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	47.317.371,94	7,12%		1.139.569.590,12	4,15%	OK	OK	OK	0,19%	-1,39%	5,47%	13,47%	5,47%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	43.108.929,09	6,49%		1.569.871.960,63	2,75%	OK	OK	OK	0,15%	-1,42%	5,56%	13,68%	5,56%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	25.163.963,08	3,79%		280.251.405,74	8,98%	OK	OK	OK	0,48%	1,19%	5,52%	11,86%	5,52%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	57.513.617,27	8,66%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.530.418,66	1,89%		188.503.678,64	6,65%	OK	OK	OK	0,96%	0,64%	5,61%	11,62%	5,61%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.090.163,97	1,97%		8.862.305.548,42	0,15%	OK	OK	OK	0,83%	2,70%	5,83%	13,30%	5,83%	
ITAU INST ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	24.395.629,53	3,67%		1.428.811.390,50	1,71%	OK	OK	OK	0,97%	0,05%	6,16%	14,12%	6,16%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.035.699,41	0,91%		8.189.814.255,93	0,07%	OK	OK	OK	0,85%	2,57%	5,65%	12,75%	5,65%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	1.461.705,70	0,22%		8.677.754.413,23	0,02%	OK	OK	OK	0,79%	2,41%	5,34%	12,13%	5,34%	
FIDC	6.576.272,05	0,99%	1,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6.576.272,05	0,99%		402.913.099,07	1,63%	OK	OK	OK	1,19%	3,41%	7,02%	15,46%	7,02%	
FIDC Fechado	122.189,81	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	24.881,21	0,00%		580.562,50	4,29%	OK	OK	OK	-9,91%	-23,52%	-94,57%	306,97%	-94,57%	
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	97.308,60	0,01%		1.955.932,46	4,98%	OK	OK	OK	-4,08%	-9,97%	-16,58%	-19,38%	-16,58%	
Fundo Crédito Privado			5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	44.358.108,34	6,68%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.136.482,62	1,38%		43.679.484,03	20,92%	OK	OK	OK	1,76%	0,43%	4,62%	23,58%	4,62%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.240.328,43	0,79%		411.095.148,10	1,27%	OK	OK	OK	0,17%	-6,96%	-2,61%	16,55%	-2,61%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	29.981.297,29	4,51%		494.205.529,96	6,07%	OK	OK	OK	0,87%	-2,11%	6,64%	18,22%	6,64%	
Fundos de Índices de Ações	5.650.815,00	0,85%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.650.815,00	0,85%		24.509.475,73	23,06%	OK	OK	OK	0,15%	-3,21%	4,20%	21,68%	4,20%	
Fundos de Ações	43.273.814,97	6,52%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	16.955.745,64	2,55%		142.182.524,38	11,93%	OK	OK	OK	0,00%	-4,78%	3,22%	23,50%	3,22%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	1.938.874,12	0,29%		110.517.122,32	1,75%	OK	OK	OK	0,21%	-4,55%	0,63%	18,45%	0,63%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	10.374.260,23	1,56%		230.529.219,89	4,50%	OK	OK	OK	-0,68%	-3,64%	9,85%	19,79%	9,85%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.957.041,60	0,90%		361.558.148,65	1,65%	OK	OK	OK	-0,12%	-1,69%	4,48%	10,28%	4,48%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.053.383,40	0,46%		174.061.920,85	1,75%	OK	OK	OK	0,25%	-6,42%	-2,23%	9,89%	-2,23%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.994.509,98	0,75%		147.969.141,45	3,38%	OK	OK	OK	-1,26%	-9,96%	0,72%	29,66%	0,72%	
Fundos Multimercados	8.071.756,41	1,22%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.057.428,41	0,46%		120.145.982,52	2,54%	OK	OK	OK	0,90%	1,51%	5,03%	11,85%	5,03%	
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	5.014.328,00	0,76%		32.583.104,68	15,39%	OK	OK	OK	0,29%	-	-	-	-	
Fundos de Participações	7.727.846,77	1,16%	3,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	499.957,57	0,08%		225.320.519,82	0,22%	OK	OK	OK	-0,10%	-0,30%	-0,65%	-7,01%	-0,65%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	742.893,59	0,11%		187.605.412,60	0,40%	OK	OK	OK	-0,67%	-1,81%	-5,43%	-8,84%	-5,43%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.484.995,61	0,98%		46.043.468,80	14,08%	OK	OK	OK	0,17%	0,23%	1,14%	-9,95%	1,14%	
Fundos de Investimento Imobiliários	12.957.359,67	1,95%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.000.000,00	0,60%		160.110.159,84	2,50%	OK	OK	OK	-2,44%	-19,08%	-17,36%	-23,07%	-17,36%	
FII RB CAPITAL RENDA II	8.957.359,67	1,35%		137.530.957,84	6,51%	OK	OK	OK	1,34%	14,69%	27,69%	38,10%	27,69%	
Disponibilidades Financeiras	313.440,99	0,05%												

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.