

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

5/31/2017

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	542,134,545.06	82.29%	162.00%							-0.40%	0.99%	8.51%	15.10%	5.17%
RV	116,675,765.30	17.71%	41.00%							-3.43%	-4.86%	2.95%	19.37%	4.43%
CONSOLIDADO	658,829,179.70	100.00%	211.00%							-0.95%	-0.13%	7.47%	16.13%	5.00%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0.87%	2.22%	4.52%	9.52%	3.85%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0.82%	2.16%	4.68%	9.79%	3.84%
Títulos Públicos	121,814,846.36	18.49%	40.00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	121,814,846.36	18.49%								-0.66%	-0.10%	8.41%	15.20%	5.17%
Fundos que contenham somente títulos públicos	208,013,180.55	31.57%	50.00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	24,254,571.15	3.68%		5,002,527,410.37	0.48%	OK	OK	OK	0.25%	2.24%	8.61%	17.38%	6.68%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	57,616,126.63	8.75%		3,144,797,406.43	1.83%	OK	OK	OK	0.30%	2.21%	8.63%	17.42%	6.70%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	48,051,167.50	7.29%		5,886,860,281.32	0.82%	OK	OK	OK	0.08%	2.17%	6.30%	12.18%	4.86%	
GF FC FI RF IMA B	12,732,302.09	1.93%		102,357,869.12	12.44%	OK	OK	OK	-1.94%	-1.11%	7.58%	14.43%	4.62%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6,337,372.82	0.96%		1,928,742,039.97	0.33%	OK	OK	OK	0.03%	2.08%	6.16%	11.92%	4.73%	
SAFRA IMA FIC FI RF	8,943,633.68	1.36%		442,202,269.67	2.02%	OK	OK	OK	-1.69%	-0.75%	7.58%	14.15%	4.71%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	50,078,006.68	7.60%		1,301,986,719.39	3.85%	OK	OK	OK	0.05%	2.14%	6.29%	12.16%	4.84%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	146,027,451.86	22.16%	35.00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	30,712,036.32	4.66%		1,925,065,110.93	1.60%	OK	OK	OK	0.09%	2.18%	6.30%	12.18%	4.87%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	47,228,091.52	7.17%		1,175,585,726.13	4.02%	OK	OK	OK	-1.24%	-0.55%	8.31%	15.34%	5.27%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	43,043,640.78	6.53%		1,624,503,691.36	2.65%	OK	OK	OK	-1.18%	-0.52%	8.57%	15.71%	5.40%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	25,043,683.24	3.80%		279,603,229.02	8.96%	OK	OK	OK	0.04%	2.17%	6.52%	12.31%	5.02%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	59,634,578.83	9.05%	30.00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	24,160,936.61	3.67%		1,415,332,082.19	1.71%	OK	OK	OK	-1.11%	0.40%	7.37%	15.30%	5.14%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12,982,043.08	1.97%		9,062,128,817.01	0.14%	OK	OK	OK	0.93%	2.92%	6.13%	13.69%	4.95%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	10,079,784.24	1.53%		8,642,305,359.60	0.12%	OK	OK	OK	0.87%	2.63%	5.62%	12.49%	4.52%	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12,411,814.90	1.88%		187,966,958.48	6.60%	OK	OK	OK	-1.10%	1.20%	6.05%	11.91%	4.61%	
FIDC	6,515,420.00	0.99%	1.00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6,515,420.00	0.99%		399,184,833.60	1.63%	OK	OK	OK	1.07%	3.22%	6.91%	15.39%	5.55%	
FIDC Fechado	129,067.46	0.02%	1.00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	27,619.63	0.00%		644,459.24	4.29%	OK	OK	OK	-6.65%	-23.36%	-26.66%	353.44%	-93.97%	
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	101,447.83	0.02%		2,039,132.26	4.98%	OK	OK	OK	-3.20%	-8.89%	-16.20%	-17.55%	-13.04%	
Fundo Crédito Privado			5.00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações Referenciados	43,931,517.00	6.67%	15.00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	8,978,684.54	1.36%		42,925,086.61	20.92%	OK	OK	OK	-2.31%	-5.03%	1.38%	27.51%	2.81%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5,231,246.62	0.79%		435,595,586.22	1.20%	OK	OK	OK	-5.93%	-9.22%	-1.40%	21.72%	-2.78%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	29,721,585.84	4.51%		505,656,714.01	5.88%	OK	OK	OK	-4.09%	-4.77%	4.13%	23.67%	5.71%	
Fundos de Índices de Ações	5,642,298.58	0.86%	2.00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5,642,298.58	0.86%		24,421,794.18	23.10%	OK	OK	OK	-4.03%	-5.87%	1.24%	28.82%	4.04%	
Fundos de Ações	43,404,196.36	6.59%	15.00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	16,956,107.80	2.57%		143,814,247.03	11.79%	OK	OK	OK	-5.00%	-7.40%	-1.32%	31.64%	3.23%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	1,934,766.69	0.29%		119,551,162.78	1.62%	OK	OK	OK	-5.74%	-8.50%	-1.36%	22.79%	0.42%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	10,444,868.16	1.59%		230,137,776.63	4.54%	OK	OK	OK	-4.66%	-5.26%	13.10%	26.28%	10.59%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5,964,472.92	0.91%		362,009,269.51	1.65%	OK	OK	OK	-3.31%	-2.58%	4.06%	13.17%	4.61%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3,045,769.27	0.46%		217,763,432.86	1.40%	OK	OK	OK	-5.34%	-8.48%	-0.31%	13.90%	-2.47%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5,058,211.52	0.77%		150,441,912.15	3.36%	OK	OK	OK	-8.39%	-11.41%	1.23%	40.79%	2.01%	
Fundos Multimercados	3,030,184.98	0.46%	3.00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3,030,184.98	0.46%		123,094,236.45	2.46%	OK	OK	OK	-0.14%	1.22%	4.82%	12.50%	4.09%	
Fundos de Participações	7,722,459.03	1.17%	3.00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	500,455.89	0.08%		225,545,096.59	0.22%	OK	OK	OK	-0.11%	-0.37%	-0.65%	-6.99%	-0.55%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	747,906.99	0.11%		188,871,532.90	0.40%	OK	OK	OK	-0.65%	-1.80%	-5.36%	-18.14%	-4.79%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6,474,096.15	0.98%		45,966,082.56	14.08%	OK	OK	OK	-0.23%	0.81%	0.73%	-16.03%	0.97%	
Fundos de Investimento Imobiliários	12,945,109.35	1.96%	3.00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4,100,000.00	0.62%		167,753,034.57	2.44%	OK	OK	OK	-9.19%	-21.15%	-25.05%	-30.51%	-15.29%	
FII RB CAPITAL RENDA II	8,845,109.35	1.34%		137,164,338.43	6.45%	OK	OK	OK	8.62%	13.43%	28.41%	35.37%	26.00%	
Disponibilidades Financeiras	18,869.34	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.