

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

31/03/2017

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	539.445.290,45	81,78%	162,00%							1,24%	5,42%	9,16%	18,05%	5,42%
RV	120.212.814,04	18,22%	41,00%							-2,01%	7,56%	8,44%	23,31%	7,56%
CONSOLIDADO	659.658.104,49	100,00%	211,00%							0,64%	5,96%	9,45%	19,49%	5,96%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										0,81%	2,46%	4,36%	10,84%	2,46%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,74%	2,44%	4,72%	10,85%	2,44%
Títulos Públicos	126.548.216,12	19,18%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	126.548.216,12	19,18%		-		OK	OK			1,06%	6,39%	9,24%	17,76%	6,39%
Fundos que contenham somente títulos públicos	201.914.693,08	30,61%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	23.423.196,92	3,55%		4.952.567.108,47	0,47%	OK	OK	OK		1,47%	5,89%	9,44%	20,94%	5,89%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	57.172.428,75	8,67%		2.763.416.568,18	2,07%	OK	OK	OK		1,43%	5,88%	9,49%	21,04%	5,88%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	44.460.143,28	6,74%		5.761.023.230,35	0,77%	OK	OK	OK		1,38%	4,05%	6,36%	13,89%	4,05%
GF FC FI RF IMA B	13.017.445,57	1,97%		81.102.227,99	16,05%	OK	OK	OK		1,10%	6,96%	9,51%	21,53%	6,96%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.292.402,59	0,95%		1.967.281.822,23	0,32%	OK	OK	OK		1,35%	3,99%	6,25%	13,66%	3,99%
SAFRA IMA FIC FI RF	9.122.271,78	1,38%		429.907.422,11	2,12%	OK	OK	OK		1,23%	6,80%	9,04%	20,35%	6,80%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	48.426.804,19	7,34%		1.053.698.055,10	4,60%	OK	OK	OK		1,38%	4,06%	6,37%	13,91%	4,06%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	146.412.766,92	22,20%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	29.828.488,47	4,52%		1.981.038.461,24	1,51%	OK	OK	OK		1,38%	4,05%	6,34%	13,92%	4,05%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	47.986.618,48	7,27%		1.303.474.709,01	3,68%	OK	OK	OK		1,05%	6,96%	9,42%	21,57%	6,96%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	43.728.847,98	6,63%		1.671.596.593,45	2,62%	OK	OK	OK		1,06%	7,08%	9,67%	22,16%	7,08%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	24.868.811,99	3,77%		267.792.387,25	9,29%	OK	OK	OK		1,45%	4,29%	6,64%	14,22%	4,29%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	58.040.231,63	8,80%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.450.935,68	1,89%		180.464.725,01	6,90%	OK	OK	OK		1,52%	4,94%	7,12%	15,06%	4,94%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.746.330,87	1,93%		7.549.648.257,31	0,17%	OK	OK	OK		1,05%	3,05%	6,61%	14,06%	3,05%
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	24.382.242,99	3,70%		1.379.440.423,38	1,77%	OK	OK	OK		1,32%	6,11%	9,19%	20,42%	6,11%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	8.460.722,09	1,28%		8.687.047.126,70	0,10%	OK	OK	OK		1,00%	2,86%	6,02%	12,98%	2,86%
FIDC	6.388.764,32	0,97%	1,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6.388.764,32	0,97%		375.476.402,91	1,70%	OK	OK	OK		1,21%	3,50%	7,37%	15,98%	3,50%
FIDC Fechado	140.618,38	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	32.531,58	0,00%		759.071,57	4,29%	OK	OK	OK		-9,73%	-92,90%	-22,39%	531,87%	-92,90%
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	108.086,80	0,02%		2.172.577,65	4,98%	OK	OK	OK		-2,93%	-7,35%	-15,10%	-19,24%	-7,35%
Fundo Crédito Privado			5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:		
Fundos de Ações Referenciados	45.358.378,13	6,88%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.097.292,17	1,38%		42.079.629,15	21,62%	OK	OK	OK		-3,77%	4,17%	7,78%	28,70%	4,17%
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.632.089,60	0,85%		537.745.276,70	1,05%	OK	OK	OK		-2,26%	4,67%	11,27%	23,53%	4,67%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	30.628.996,36	4,64%		522.843.450,93	5,86%	OK	OK	OK		-1,86%	8,94%	10,18%	27,90%	8,94%
Fundos de Índices de Ações	5.838.353,72	0,89%	2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.838.353,72	0,89%		24.560.904,45	23,77%	OK	OK	OK		-2,60%	7,65%	11,14%	29,58%	7,65%
Fundos de Ações	45.474.547,77	6,89%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.807.777,99	2,70%		149.997.046,02	11,87%	OK	OK	OK		-2,75%	8,41%	10,52%	30,39%	8,41%
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.031.263,04	0,31%		129.103.572,40	1,57%	OK	OK	OK		-3,94%	5,43%	7,46%	23,93%	5,43%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	10.766.482,37	1,63%		184.150.305,46	5,85%	OK	OK	OK		-2,35%	14,00%	16,71%	34,43%	14,00%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.059.395,10	0,92%		367.770.369,37	1,65%	OK	OK	OK		-1,03%	6,28%	5,77%	14,97%	6,28%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.262.938,08	0,49%		260.156.878,49	1,25%	OK	OK	OK		-1,96%	4,48%	5,03%	13,81%	4,48%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.546.691,19	0,84%		150.893.973,73	3,68%	OK	OK	OK		-2,85%	11,86%	27,30%	51,27%	11,86%
Fundos Multimercados	3.012.072,38	0,46%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.012.072,38	0,46%		130.699.076,66	2,30%	OK	OK	OK		0,61%	3,47%	7,08%	13,54%	3,47%
Fundos de Participações	7.727.860,31	1,17%	3,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	501.444,44	0,08%		225.990.623,26	0,22%	OK	OK	OK		-0,18%	-0,35%	-0,64%	-2,62%	-0,35%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	756.600,46	0,11%		191.066.983,50	0,40%	OK	OK	OK		-0,66%	-3,69%	-5,27%	-17,51%	-3,69%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.469.815,41	0,98%		45.935.689,28	14,08%	OK	OK	OK		0,74%	0,91%	-10,78%	-11,50%	0,91%
Fundos de Investimento Imobiliários	12.801.601,73	1,94%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	4.943.000,00	0,75%		164.159.583,26	3,01%	OK	OK	OK		-4,94%	2,13%	-20,27%	-14,63%	2,13%
FII RB CAPITAL RENDA II	7.858.601,73	1,19%		135.826.332,85	5,79%	OK	OK	OK		0,84%	11,34%	13,17%	23,71%	11,34%
Disponibilidades Financeiras		0,000%												

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.