

# ENQUADRAMENTO LEGAL



**SBCPREV FFIN2**

**29/09/2017**

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	578.017.495,48	79,35%	162,00%							1,39%	5,82%	6,15%	15,88%	11,91%
RV	150.375.136,20	20,64%	41,00%							5,63%	23,27%	20,04%	30,17%	29,11%
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>728.398.022,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>211,00%</b>							<b>2,24%</b>	<b>9,02%</b>	<b>8,78%</b>	<b>18,85%</b>	<b>15,10%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										0,44%	1,61%	3,20%	7,65%	5,72%
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										0,62%	2,09%	3,77%	8,61%	6,28%
<b>Títulos Públicos</b>	<b>123.481.559,96</b>	<b>16,95%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTEIRA PROPRIA FFIN2	123.481.559,96	16,95%								1,56%	6,82%	5,91%	15,69%	12,68%
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>242.919.687,99</b>	<b>33,35%</b>	<b>50,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	26.939.905,73	3,70%		4.989.933.175,82	0,54%	OK	OK	OK	1,45%	4,87%	7,06%	17,16%	13,36%	
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	98.900.892,80	13,58%		3.093.607.731,13	3,20%	OK	OK	OK	1,44%	4,83%	7,06%	17,22%	13,36%	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	50.774.967,66	6,97%		6.273.482.056,63	0,81%	OK	OK	OK	0,99%	5,13%	6,49%	13,27%	10,80%	
GF FC FI RF IMA B	13.661.935,11	1,88%		85.945.174,35	15,90%	OK	OK	OK	1,78%	7,18%	4,95%	14,94%	12,25%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.693.110,66	0,92%		1.877.355.547,88	0,36%	OK	OK	OK	0,97%	5,07%	6,37%	13,01%	10,61%	
SAFRA IMA FIC FI RF	12.189.588,70	1,67%		407.543.449,80	2,99%	OK	OK	OK	1,81%	7,68%	5,68%	15,23%	12,86%	
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	33.759.287,33	4,63%		1.302.582.730,64	2,59%	OK	OK	OK	0,99%	5,13%	6,45%	13,24%	10,77%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>141.582.802,94</b>	<b>19,44%</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	17.970.352,39	2,47%		1.993.423.540,77	0,90%	OK	OK	OK	0,99%	5,16%	6,53%	13,28%	10,84%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	50.788.715,72	6,97%		1.309.486.949,77	3,88%	OK	OK	OK	1,84%	7,34%	5,84%	15,81%	13,20%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	46.311.649,86	6,36%		1.698.626.671,43	2,73%	OK	OK	OK	1,83%	7,43%	5,91%	16,15%	13,41%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	26.512.084,97	3,64%		303.020.808,14	8,75%	OK	OK	OK	1,02%	5,36%	6,61%	13,68%	11,18%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>63.159.713,83</b>	<b>8,67%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	15.651.219,49	2,15%		201.163.071,04	7,78%	OK	OK	OK	1,47%	4,28%	4,95%	12,42%	10,13%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	13.415.498,24	1,84%		11.514.086.382,12	0,12%	OK	OK	OK	0,67%	2,49%	5,25%	12,20%	8,46%	
ITAU INSTIT ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	25.689.506,73	3,53%		1.524.890.880,87	1,68%	OK	OK	OK	1,51%	5,30%	5,36%	15,04%	11,79%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	6.171.011,76	0,85%		7.596.415.591,82	0,08%	OK	OK	OK	0,63%	2,24%	4,87%	11,46%	8,02%	
SANTANDER FC CORPORATE REF DI	1.640.591,40	0,23%		6.857.988.274,06	0,02%	OK	OK	OK	0,65%	2,31%	4,98%	11,74%	8,20%	
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	591.886,21	0,08%		8.834.792.916,47	0,01%	OK	OK	OK	0,59%	2,10%	4,57%	10,86%	7,56%	
<b>FIDC</b>	<b>6.747.501,85</b>	<b>0,93%</b>	<b>1,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	6.747.501,85	0,93%		402.580.423,49	1,68%	OK	OK	OK	0,93%	3,44%	6,96%	14,84%	10,71%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>126.228,91</b>	<b>0,02%</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	37.097,92	0,01%		865.619,72	4,29%	OK	OK	OK	-42,75%	49,10%	14,04%	-11,50%	-91,90%	
FIDC Trendbank B.F. MULT-SEN	89.130,99	0,01%		1.791.560,17	4,98%	OK	OK	OK	9,96%	-8,40%	-17,54%	-29,99%	-23,59%	
<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>51.497.098,39</b>	<b>7,07%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	10.627.897,11	1,46%		50.945.872,06	20,86%	OK	OK	OK	4,49%	16,32%	16,82%	25,92%	21,70%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	5.661.750,89	0,78%		355.309.632,58	1,59%	OK	OK	OK	3,49%	8,04%	0,53%	11,86%	5,23%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	35.207.450,39	4,83%		584.223.476,25	6,03%	OK	OK	OK	4,93%	17,43%	14,95%	26,65%	25,23%	
<b>Fundos de Índices de Ações</b>	<b>6.656.847,07</b>	<b>0,91%</b>	<b>2,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso II</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	6.656.847,07	0,91%		30.307.966,27	21,96%	OK	OK	OK	4,78%	17,80%	14,02%	26,72%	22,75%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>51.579.824,38</b>	<b>7,08%</b>	<b>15,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
ARX INCOME FI EM ACOES	20.159.636,91	2,77%		161.346.452,22	12,49%	OK	OK	OK	4,24%	18,90%	13,21%	25,12%	22,73%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.376.068,61	0,33%		136.413.592,47	1,74%	OK	OK	OK	6,41%	22,55%	16,97%	25,71%	23,33%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	13.175.366,47	1,81%		336.785.860,02	3,91%	OK	OK	OK	5,82%	27,00%	22,37%	42,82%	39,50%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.741.497,87	0,93%		421.402.170,14	1,60%	OK	OK	OK	4,45%	13,17%	11,26%	17,68%	18,24%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.214.148,40	0,44%		109.235.244,97	2,94%	OK	OK	OK	2,04%	5,27%	-1,50%	3,46%	2,92%	
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.913.106,12	0,81%		170.445.183,85	3,47%	OK	OK	OK	6,05%	18,39%	6,61%	35,71%	19,25%	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>8.425.510,54</b>	<b>1,16%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.168.420,54	0,43%		102.312.263,45	3,10%	OK	OK	OK	1,33%	3,63%	5,19%	12,64%	8,84%	
ITAU INST CAPITAL PROT IBOVESPA MULTI FI	5.257.090,00	0,72%		34.160.573,75	15,39%	OK	OK	OK	0,95%	4,84%	-	-	-	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>15.878.301,78</b>	<b>2,18%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	466.784,65	0,06%		210.370.171,91	0,22%	OK	OK	OK	-0,12%	-6,64%	-6,91%	-7,50%	-7,24%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	728.012,09	0,10%		183.847.498,42	0,40%	OK	OK	OK	-0,61%	-2,00%	-3,78%	-8,85%	-7,32%	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.683.505,04	2,02%		104.252.885,67	14,08%	OK	OK	OK	0,09%	126,42%	126,95%	102,48%	129,01%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>16.337.554,04</b>	<b>2,24%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
DOMO FII	7.500.000,00	1,03%		160.569.648,30	4,67%	OK	OK	OK	43,68%	87,50%	51,73%	20,97%	54,96%	
FII RB CAPITAL RENDA II	8.837.554,04	1,21%		151.587.547,86	5,83%	OK	OK	OK	-0,69%	-1,35%	13,14%	28,04%	25,97%	
<b>Disponibilidades Financeiras</b>	<b>5.391,14</b>	<b>0,00%</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.