

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV FFIN2

31/07/2015

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	
CONSOLIDADO META ATUARIAL (INPC + 6%) META ATUARIAL (IPCA + 6%)	477.724.990,63	100,00%	161,00%							0,46% 1,07% 1,11%	1,77% 3,86% 3,66%	6,59% 8,98% 8,64%	9,78% 16,39% 16,13%	7,33% 11,14% 10,52%
Títulos Públicos	62.644.701,96	13,11%	20,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PRÓPRIA FFIN2	62.644.701,96	13,11%								-0,10%	1,70%	6,67%	13,03%	8,49%
Fundos que contenham somente títulos públicos	132.779.248,60	27,79%	35,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	50.678.493,66	10,61%		3.954.737.797,97	1,28%	OK	OK	OK	OK	1,76%	4,27%	6,95%	12,79%	9,09%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	27.276.451,63	5,71%		1.759.951.325,04	1,55%	OK	OK	OK	OK	1,74%	4,20%	6,93%	12,62%	9,08%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	54.824.303,31	11,48%		858.463.514,53	6,39%	OK	OK	OK	OK	1,77%	4,28%	7,06%	12,91%	9,23%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	129.835.147,81	27,18%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B	35.001.235,79	7,33%		1.445.953.159,68	2,42%	OK	OK	OK	OK	-0,75%	1,51%	4,16%	11,04%	7,39%
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB ATIVO TP FI LP	59.511.989,22	12,46%		1.000.256.566,82	5,95%	OK	OK	OK	OK	1,75%	4,25%	6,93%	12,66%	9,06%
BRADESCO FI RF IMA B	29.867.810,97	6,25%		1.138.982.934,37	2,62%	OK	OK	OK	OK	-0,75%	1,59%	4,40%	11,42%	7,62%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.454.111,83	1,14%		118.585.928,35	4,60%	OK	OK	OK	OK	1,77%	4,30%	6,95%	-	9,03%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	19.695.498,22	4,12%	15,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	10.244.163,44	2,14%		5.789.316.111,28	0,18%	OK	OK	OK	OK	1,18%	3,29%	6,26%	12,29%	7,26%
QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	7.449.991,41	1,56%		156.774.678,54	4,75%	OK	OK	OK	OK	0,76%	3,06%	5,52%	9,70%	6,58%
SANTANDER FIC FI MASTER REF DI	2.001.343,37	0,42%		4.138.145.126,09	0,05%	OK	OK	OK	OK	1,13%	3,10%	5,86%	11,36%	6,78%
FIDC	4.983.372,52	1,04%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANÇ SUPPLIER SENIOR 1	4.983.372,52	1,04%		268.723.133,52	1,85%	OK	OK	OK	OK	1,35%	3,76%	7,13%	14,00%	8,28%
FIDC Fechado	400.461,34	0,08%	2,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	234.745,34	0,05%		5.477.400,90	4,29%	OK	OK	OK	OK	-1,69%	-5,73%	-7,49%	172,90%	-7,09%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	165.716,00	0,03%		3.304.906,36	5,01%	OK	OK	OK	OK	-0,66%	-	1,78%	-	-
Fundo Crédito Privado	25.302.056,43	5,30%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA VI RF CRED PRIV	9.167.750,93	1,92%		92.638.256,81	9,90%	OK	OK	OK	OK	1,17%	3,54%	8,40%	14,92%	10,01%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	8.603.875,00	1,80%		95.114.983,80	9,05%	OK	OK	OK	OK	1,19%	3,55%	8,63%	15,43%	10,09%
CAIXA FI BRASIL IPCA XV RF CRED PRIV	7.530.430,50	1,58%		87.446.008,17	8,61%	OK	OK	OK	OK	1,11%	3,49%	8,54%	15,43%	10,03%
Fundos de Ações Referenciados	44.408.624,31	9,30%	15,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FIC FIA	7.394.782,30	1,55%		62.482.424,79	11,83%	OK	OK	OK	OK	-4,23%	-7,19%	9,22%	-7,34%	2,68%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	4.898.169,14	1,03%		25.840.365,97	18,96%	OK	OK	OK	OK	-1,43%	-4,10%	10,96%	-1,92%	4,20%
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.586.473,98	0,96%		25.434.072,81	18,03%	OK	OK	OK	OK	-4,03%	-9,42%	8,33%	-9,11%	0,21%
GERACAO FIA PROGRAMADO	3.315.942,14	0,69%		545.737.925,46	0,61%	OK	OK	OK	OK	2,54%	0,46%	15,64%	-6,69%	4,23%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	24.213.256,75	5,07%		484.804.035,19	4,99%	OK	OK	OK	OK	-2,04%	-6,11%	8,25%	-5,09%	1,31%
Fundos de Índices de Ações			2,00%			Art. 8o, Inciso II						Alocação:		
Fundos de Ações	36.068.050,42	7,55%	15,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	11.875.373,63	2,49%		149.378.089,90	7,95%	OK	OK	OK	OK	-2,34%	-5,06%	8,75%	-5,67%	2,29%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	6.987.210,26	1,46%		1.510.082.059,09	0,46%	OK	OK	OK	OK	0,60%	0,11%	17,95%	12,15%	12,60%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.188.290,49	1,09%		314.899.374,04	1,65%	OK	OK	OK	OK	-1,08%	-1,56%	4,99%	-0,66%	-1,04%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	4.058.482,22	0,85%		122.112.885,87	3,32%	OK	OK	OK	OK	-0,67%	-8,88%	2,50%	-23,21%	-5,69%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	7.958.693,82	1,67%		117.045.627,14	6,80%	OK	OK	OK	OK	0,51%	-2,44%	5,51%	-8,97%	-5,35%
Fundos Multimercados	2.539.819,30	0,53%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	2.539.819,30	0,53%		220.173.548,70	1,15%	OK	OK	OK	OK	2,35%	4,56%	9,67%	15,24%	8,99%
Fundos de Participações	5.644.949,62	1,18%	5,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	229.405,48	0,05%		103.735.542,15	0,22%	OK	OK	OK	OK	-0,73%	-1,99%	-3,85%	-6,00%	-4,80%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	947.802,02	0,20%		239.351.608,39	0,40%	OK	OK	OK	OK	3,42%	2,30%	-13,55%	-13,22%	-18,39%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	4.467.742,12	0,94%		31.720.969,03	14,08%	OK	OK	OK	OK	-0,15%	-0,90%	-1,88%	-3,38%	-2,07%
Fundos de Investimento Imobiliários	13.400.938,94	2,81%	5,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
DOMO FII	6.150.000,00	1,29%		191.164.622,64	3,22%	OK	OK	OK	OK	-2,38%	4,24%	-2,54%	-15,75%	-6,83%
FII RB CAPITAL RENDA II	7.250.938,94	1,52%		127.701.048,43	5,68%	OK	OK	OK	OK	0,37%	0,37%	-1,04%	-7,88%	1,71%
Disponibilidades Financeiras	22.121,16	0,005%												

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.