



ITU

29/01/2016

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>140.031.195,71</b>	<b>100,00%</b>	<b>285,00%</b>							<b>1,36%</b>	<b>2,89%</b>	<b>1,83%</b>	<b>9,11%</b>	<b>1,36%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>2,00%</b>	<b>5,08%</b>	<b>8,26%</b>	<b>17,99%</b>	<b>2,00%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,76%</b>	<b>4,79%</b>	<b>8,02%</b>	<b>17,35%</b>	<b>1,76%</b>
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>77.636.607,60</b>	<b>55,44%</b>	<b>100,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	7.349.008,13	5,25%		1.016.535.674,40	0,72%	OK	OK	OK	2,94%	5,78%	8,10%	15,09%	2,94%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	8.731.432,25	6,24%		371.817.253,53	2,35%	OK	OK	OK	2,42%	5,87%	-	-	2,42%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB VII FI	22.607.911,84	16,14%		2.012.222.726,62	1,12%	OK	OK	OK	2,38%	5,26%	7,60%	-	2,38%	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.337.879,39	3,81%		39.166.141,22	13,63%	OK	OK	OK	2,48%	6,02%	-	-	2,48%	
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	1.631.070,00	1,16%		823.705.342,89	0,20%	OK	OK	OK	1,57%	4,25%	5,60%	-	1,57%	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	14.736.260,00	10,52%		437.696.262,33	3,37%	OK	OK	OK	3,56%	6,78%	3,90%	-	3,56%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	4.182.456,00	2,99%		147.601.767,98	2,83%	OK	OK	OK	1,59%	5,44%	-	-	1,59%	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	7.931.015,40	5,66%		165.876.251,53	4,78%	OK	OK	OK	2,36%	4,64%	-1,71%	-	2,36%	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5.129.574,59	3,66%		2.602.621.726,95	0,20%	OK	OK	OK	2,87%	5,42%	8,88%	16,63%	2,87%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>644.791,45</b>	<b>0,46%</b>	<b>80,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	644.791,45	0,46%		157.617.575,16	0,41%	OK	OK	OK	4,07%	6,44%	7,70%	15,14%	4,07%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>19.476.669,31</b>	<b>13,91%</b>	<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA FI	10.892.971,47	7,78%		233.636.912,71	4,66%	OK	OK	OK	1,90%	5,56%	3,94%	7,97%	1,90%	
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	1.567.100,06	1,12%		1.159.126.532,19	0,14%	OK	OK	OK	0,98%	3,10%	6,34%	12,51%	0,98%	
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	182.368,57	0,13%		6.435.498.720,79	0,00%	OK	OK	OK	1,05%	3,33%	6,83%	13,59%	1,05%	
BTG PACTUAL NTN B FI RENDA FIXA	1.738.197,45	1,24%		137.379.895,96	1,27%	OK	OK	OK	1,47%	1,51%	4,56%	10,66%	1,47%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	3.648.414,00	2,61%		1.219.401.630,57	0,30%	OK	OK	OK	1,49%	4,52%	7,65%	17,39%	1,49%	
CAIXA FI BRASIL DI LP	1.447.617,76	1,03%		4.275.212.208,31	0,03%	OK	OK	OK	1,05%	3,29%	6,80%	13,45%	1,05%	
<b>Fundos de Índice Renda Fixa ( Normal )</b>			<b>30,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>		
<b>FIDC</b>	<b>3.663.842,66</b>	<b>2,62%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	3.663.842,66	2,62%		283.908.953,23	1,29%	OK	OK	OK	1,21%	3,81%	7,83%	15,53%	1,21%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>4.292.091,85</b>	<b>3,07%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC ITALIA SEN	77.920,11	0,06%		88.238.893,88	0,09%	OK	OK	OK	-1,59%	5,45%	1,86%	31,41%	-1,59%	
FIDC MULTI SILVERADO MAXIMUM 7 SERIE	1.853.487,27	1,32%		69.566.201,32	2,66%	OK	OK	OK	1,37%	-21,76%	-18,33%	-11,71%	1,37%	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III SENIOR	5.592,27	0,00%		4.111.596,73	0,14%	OK	OK	OK	-6,04%	-12,48%	-23,59%	-49,85%	-6,04%	
RURAL FIDC PREMIUM SENIOR	2.355.092,20	1,68%		124.269.500,40	1,90%	OK	OK	OK	3,96%	11,07%	14,68%	26,21%	3,96%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>6.613.443,89</b>	<b>4,72%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI	3.001.209,75	2,14%		290.040.957,67	1,03%	OK	OK	OK	2,74%	6,31%	6,04%	12,49%	2,74%	
BB RPPS RF CRED PRIV IPCA II FI	504.179,33	0,36%		83.932.413,85	0,60%	OK	OK	OK	2,42%	4,96%	9,16%	17,74%	2,42%	
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	1.414.808,19	1,01%		2.921.124.932,59	0,05%	OK	OK	OK	1,08%	3,38%	6,96%	13,71%	1,08%	
CAIXA FI BRASIL IPCA IX RF CRED PRIV	1.416.798,12	1,01%		96.407.377,16	1,47%	OK	OK	OK	1,39%	4,28%	7,23%	16,40%	1,39%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	276.448,50	0,20%		101.870.373,74	0,27%	OK	OK	OK	1,39%	4,14%	7,10%	16,35%	1,39%	

# ENQUADRAMENTO LEGAL



ITU

29/01/2016

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>140.031.195,71</b>	<b>100,00%</b>	<b>285,00%</b>							<b>1,36%</b>	<b>2,89%</b>	<b>1,83%</b>	<b>9,11%</b>	<b>1,36%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>2,00%</b>	<b>5,08%</b>	<b>8,26%</b>	<b>17,99%</b>	<b>2,00%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,76%</b>	<b>4,79%</b>	<b>8,02%</b>	<b>17,35%</b>	<b>1,76%</b>
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>3.048.599,09</b>	<b>2,18%</b>	<b>3,00%</b>			<b>Art. 8o, inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	1.800.610,82	1,29%		30.374.004,18	5,93%	OK	OK	OK	-6,65%	-11,16%	-20,17%	-13,47%	-6,65%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	1.247.988,27	0,89%		458.206.513,76	0,27%	OK	OK	OK	-8,02%	-6,54%	-11,15%	2,75%	-8,02%	
<b>Fundos de Ações</b>	<b>14.839.597,53</b>	<b>10,60%</b>	<b>14,00%</b>			<b>Art. 8o, inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB ACOES PIPE FC	310.535,27	0,22%		73.001.679,35	0,43%	OK	OK	OK	-0,38%	-4,17%	-10,69%	0,16%	-0,38%	
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FC	272.324,60	0,19%		35.750.659,67	0,76%	OK	OK	OK	-6,47%	-9,91%	-16,73%	-6,43%	-6,47%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	4.260.328,72	3,04%		284.449.588,94	1,50%	OK	OK	OK	-0,50%	-4,67%	-12,68%	2,99%	-0,50%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	1.862.219,63	1,33%		131.089.195,41	1,42%	OK	OK	OK	-0,61%	-4,20%	-10,78%	0,46%	-0,61%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	320.526,47	0,23%		298.688.442,25	0,11%	OK	OK	OK	-3,01%	-0,92%	-5,15%	-0,41%	-3,01%	
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	248.547,75	0,18%		157.650.853,09	0,16%	OK	OK	OK	-2,48%	0,85%	-4,40%	-4,77%	-2,48%	
GERACAO FIA	3.268.413,71	2,33%		126.144.507,30	2,59%	OK	OK	OK	-8,03%	-6,61%	-10,80%	3,50%	-8,03%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.238.748,63	1,60%		256.212.171,47	0,87%	OK	OK	OK	-5,82%	-6,01%	-11,51%	3,17%	-5,82%	
LEGAN CAPSE FI ACOES	778.088,12	0,56%		30.601.422,47	2,54%	OK	OK	OK	-4,28%	-7,84%	-18,85%	-14,21%	-4,28%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	1.279.864,63	0,91%		88.678.021,83	1,44%	OK	OK	OK	-	-	-	-	-	
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>6.280.023,90</b>	<b>4,48%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 8o, inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BTG PACT CRE COR I FIC FI MULT CRED PRIV	2.498.265,68	1,78%		1.013.744.777,30	0,25%	OK	OK	OK	0,79%	3,13%	6,85%	13,93%	0,79%	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	674.428,03	0,48%		196.375.296,53	0,34%	OK	OK	OK	0,81%	3,75%	5,73%	15,96%	0,81%	
VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI	2.079.992,22	1,49%		137.042.494,90	1,52%	OK	OK	OK	2,46%	5,48%	6,72%	14,38%	2,46%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	1.027.337,97	0,73%		166.147.428,03	0,62%	OK	OK	OK	-6,00%	-4,42%	-2,58%	8,24%	-6,00%	
<b>Fundos de Participações</b>	<b>1.994.289,01</b>	<b>1,42%</b>	<b>4,00%</b>			<b>Art. 8o, inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	483.991,61	0,35%		362.814.991,60	0,13%	OK	OK	OK	-19,71%	99,30%	51,58%	31,04%	-19,71%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	576.682,02	0,41%		299.398.900,71	0,19%	OK	OK	OK	0,08%	-	-	-	0,08%	
FIP BRASIL OLEO & GAS FI EM PARTICIP	320.955,76	0,23%		80.238.938,15	0,40%	OK	OK	OK	-0,07%	-0,23%	-47,64%	-48,40%	-0,07%	
FIP INFRA BB VOT ENERG SUST II CLASSE A	612.659,62	0,44%		154.932.427,16	0,40%	OK	OK	OK	1,42%	4,31%	7,46%	11,86%	1,42%	
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>1.541.239,42</b>	<b>1,10%</b>	<b>4,00%</b>			<b>Art. 8o, inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	259.485,24	0,19%		2.910.725.221,14	0,01%	OK	OK	OK	1,32%	-3,13%	-4,72%	-7,84%	1,32%	
KINEA II REAL ESTATE EQUITY	1.281.754,18	0,92%		220.838.921,97	0,58%	OK	OK	OK	0,32%	7,01%	9,15%	25,98%	0,32%	

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.