

ENQUADRAMENTO LEGAL



ITU

9/30/2015

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	128,954,442.86	100.00%	130.00%						0.06%	-2.00%	1.80%	6.37%	4.97%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									1.00%	2.83%	6.94%	16.50%	13.07%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									1.03%	2.87%	6.74%	16.06%	12.45%
Fundos que contenham somente títulos públicos	68,186,285.66	52.88%	40.00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 20 TIT PUBL FI	2,157,384.68	1.67%		64,976,630.56	3.32%	OK	OK	OK	-2.29%	-12.09%	-5.06%	-0.35%	-3.31%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	6,775,270.76	5.25%		937,174,692.89	0.72%	OK	OK	OK	0.55%	1.35%	4.42%	10.78%	8.83%
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	21,005,215.10	16.29%		1,869,574,312.94	1.12%	OK	OK	OK	0.78%	1.46%	4.92%	-	-
BB RPPS RENDA FIXA IMA B5+ FI	5,185,964.03	4.02%		796,799,015.23	0.65%	OK	OK	OK	-1.81%	-8.17%	-2.42%	2.74%	0.30%
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	1,533,048.00	1.19%		774,203,787.34	0.20%	OK	OK	OK	1.50%	0.67%	-	-	-
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	13,500,466.00	10.47%		330,201,332.93	4.09%	OK	OK	OK	-0.05%	-	-	-	-
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	3,913,532.00	3.03%		138,111,128.88	2.83%	OK	OK	OK	-0.66%	-	-	-	-
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	7,365,789.20	5.71%		133,538,337.72	5.52%	OK	OK	OK	-1.54%	-10.89%	-5.50%	-	-
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	6,749,615.89	5.23%		1,632,164,909.15	0.41%	OK	OK	OK	0.91%	2.35%	5.40%	12.04%	9.78%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	590,250.77	0.46%	15.00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	590,250.77	0.46%		107,970,090.26	0.55%	OK	OK	OK	0.27%	0.02%	3.19%	9.29%	7.96%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	17,303,467.93	13.42%	30.00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	10,487,429.53	8.13%		224,938,682.81	4.66%	OK	OK	OK	-0.31%	-2.32%	0.77%	6.18%	4.24%
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	147,779.19	0.11%		890,413,552.93	0.02%	OK	OK	OK	1.04%	3.22%	6.16%	11.75%	8.93%
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	1,077,105.82	0.84%		5,815,160,052.45	0.02%	OK	OK	OK	1.12%	3.47%	6.71%	12.86%	9.74%
BTG PACTUAL NTNFB FI RENDA FIXA	1,692,310.65	1.31%		133,753,197.08	1.27%	OK	OK	OK	0.87%	3.07%	4.03%	9.62%	9.34%
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	3,450,012.00	2.68%		1,153,090,229.55	0.30%	OK	OK	OK	0.88%	0.15%	4.13%	9.80%	6.37%
CAIXA FI BRASIL DI LP	448,830.74	0.35%		4,095,428,943.54	0.01%	OK	OK	OK	1.12%	3.48%	6.63%	12.69%	9.64%
FIDC	3,484,862.06	2.70%	5.00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	3,484,862.06	2.70%		275,617,166.22	1.26%	OK	OK	OK	1.27%	3.95%	7.58%	14.59%	11.06%
FIDC Fechado	4,741,905.35	3.68%	5.00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
FIDC ITALIA SEN	74,437.27	0.06%		84,294,854.46	0.09%	OK	OK	OK	-2.09%	34.19%	27.78%	-4.64%	25.97%
FIDC MULTI SILVERADO MAXIMUM 7 SERIE	2,335,290.76	1.81%		87,649,540.16	2.66%	OK	OK	OK	1.44%	4.48%	8.61%	16.64%	12.58%
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III SENIOR	6,630.62	0.01%		4,875,028.77	0.14%	OK	OK	OK	-4.04%	-12.13%	-24.23%	-48.06%	-42.78%
RURAL FIDC PREMIUM SENIOR	2,325,546.70	1.80%		122,710,493.00	1.90%	OK	OK	OK	1.20%	3.36%	8.56%	17.65%	14.03%
Fundo Crédito Privado	4,848,925.83	3.76%	5.00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI	2,773,399.81	2.15%		268,025,097.49	1.03%	OK	OK	OK	-0.24%	-0.66%	2.68%	8.78%	6.44%
BB RPPS RF CRED PRIV IPCA II FI	469,247.91	0.36%		78,117,263.77	0.60%	OK	OK	OK	0.90%	3.27%	6.98%	13.81%	11.70%
CAIXA FI BRASIL IPCA IX RF CRED PRIV	1,343,587.46	1.04%		91,425,651.63	1.47%	OK	OK	OK	0.84%	2.93%	6.75%	15.54%	12.03%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	262,690.65	0.20%		96,800,622.93	0.27%	OK	OK	OK	0.74%	2.98%	7.04%	15.39%	12.04%

ENQUADRAMENTO LEGAL



ITU

9/30/2015

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	128,954,442.86	100.00%	130.00%						0.06%	-2.00%	1.80%	6.37%	4.97%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									1.00%	2.83%	6.94%	16.50%	13.07%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									1.03%	2.87%	6.74%	16.06%	12.45%
Fundos de Ações Referenciados	4,383,052.82	3.40%	3.00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	1,038,343.08	0.81%		23,867,717.35	4.35%	OK	OK	OK	-1.89%	-8.96%	-6.52%	-6.36%	-3.75%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	2,001,336.68	1.55%		33,955,933.91	5.89%	OK	OK	OK	-4.34%	-14.86%	-12.02%	-16.73%	-10.94%
GERACAO FIA PROGRAMADO	1,343,373.06	1.04%		509,892,656.82	0.26%	OK	OK	OK	2.37%	-1.93%	1.90%	-6.46%	-0.31%
Fundos de Ações	14,818,575.20	11.49%	14.00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado	
BB ACOES PIPE FC	323,040.25	0.25%		75,941,392.27	0.43%	OK	OK	OK	-2.69%	-8.29%	-3.91%	0.03%	-1.16%
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FC	298,968.17	0.23%		43,712,977.68	0.68%	OK	OK	OK	-2.08%	-11.60%	-5.38%	-5.37%	-2.53%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	4,544,422.80	3.52%		1,458,410,132.34	0.31%	OK	OK	OK	-1.47%	-6.30%	-0.42%	-6.47%	4.88%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	1,908,186.75	1.48%		605,575,531.17	0.32%	OK	OK	OK	-2.39%	-9.86%	-6.72%	-0.69%	-0.40%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	310,354.91	0.24%		289,209,919.35	0.11%	OK	OK	OK	-0.89%	-9.15%	-8.07%	-6.77%	-9.11%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	239,609.00	0.19%		151,981,216.25	0.16%	OK	OK	OK	-2.03%	-5.56%	-8.37%	-20.95%	-17.98%
GERACAO FIA	2,686,198.14	2.08%		139,285,241.19	1.93%	OK	OK	OK	2.51%	-1.59%	2.20%	-7.73%	0.06%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2,396,716.23	1.86%		272,472,829.72	0.88%	OK	OK	OK	1.59%	-2.23%	1.76%	-3.04%	-0.41%
LEGAN CAPSE FI ACOES	833,442.45	0.65%		31,554,190.39	2.64%	OK	OK	OK	-3.41%	-15.62%	-13.60%	-24.34%	-14.57%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	1,277,636.50	0.99%		98,519,905.55	1.30%	OK	OK	OK	1.37%	-1.27%	-3.08%	-10.34%	-7.03%
Fundos Multimercados	6,950,036.05	5.39%	5.00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Desenquadrado	
BTG PACT CRE COR I FIC FI MULT CRED PRIV	3,377,081.84	2.62%		1,981,263,488.94	0.17%	OK	OK	OK	1.19%	3.70%	7.06%	13.62%	10.36%
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	653,842.69	0.51%		216,172,142.08	0.30%	OK	OK	OK	1.91%	4.92%	7.70%	16.23%	11.73%
VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI	1,936,562.09	1.50%		127,592,448.37	1.52%	OK	OK	OK	0.42%	0.96%	4.50%	11.36%	8.65%
WA US INDEX 500 FI MULTI	982,549.43	0.76%		190,203,773.66	0.52%	OK	OK	OK	-1.72%	-4.12%	-1.42%	9.18%	0.77%
Fundos de Participações	2,098,339.66	1.63%	4.00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	315,860.53	0.24%		236,778,765.80	0.13%	OK	OK	OK	-0.54%	2.31%	-13.73%	-16.43%	-19.26%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP*	593,913.18	0.46%				OK	OK	OK	-	-	-	-	-
FIP BRASIL OLEO & GAS FI EM PARTICIP	606,712.27	0.47%		151,678,066.65	0.40%	OK	OK	OK	-0.23%	-0.73%	-1.52%	-2.99%	-2.15%
FIP INFRA BB VOT ENERG SUST II CLASSE A	581,853.68	0.45%		147,142,068.84	0.40%	OK	OK	OK	0.98%	3.25%	3.81%	14.68%	7.30%
Fundos de Investimento Imobiliários	1,548,741.53	1.20%	4.00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND**	325,249.20	0.25%		3,004,942,927.84	0.01%	OK	OK	OK	0.40%	1.24%	-0.60%	-0.34%	0.19%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY**	1,223,492.33	0.95%		139,158,505.14	0.88%	OK	OK	OK	0.58%	1.35%	9.89%	16.54%	18.11%

- 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.

* Até a geração do relatório, as informações não foram divulgadas.

** Todas as informações foram retiradas do portal CVM dia 16/10/2015 às 10:00 hrs.