

# ENQUADRAMENTO LEGAL



ITU

10/30/2015

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>131,335,993.64</b>	<b>100.00%</b>	<b>130.00%</b>							<b>1.54%</b>	<b>-1.04%</b>	<b>1.01%</b>	<b>6.52%</b>	<b>6.59%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>1.26%</b>	<b>3.03%</b>	<b>7.00%</b>	<b>16.95%</b>	<b>14.50%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1.31%</b>	<b>3.08%</b>	<b>6.86%</b>	<b>16.53%</b>	<b>13.92%</b>
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>70,540,385.40</b>	<b>53.71%</b>	<b>40.00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 20 TIT PUBL FI	2,249,015.18	1.71%		68,671,088.82	3.28%	OK	OK	OK	4.25%	-4.44%	-5.87%	-0.17%	0.80%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	6,947,410.45	5.29%		960,985,543.00	0.72%	OK	OK	OK	2.54%	2.19%	6.52%	12.32%	11.60%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5,039,462.67	3.84%		195,156,045.84	2.58%	OK	OK	OK	1.61%	-	-	-	-	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	21,479,155.69	16.35%		1,911,757,510.09	1.12%	OK	OK	OK	2.26%	2.23%	6.28%	-	-	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5,034,647.81	3.83%		36,941,213.38	13.63%	OK	OK	OK	0.64%	-	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	1,564,546.50	1.19%		790,110,862.33	0.20%	OK	OK	OK	2.05%	1.29%	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	13,800,122.00	10.51%		355,647,719.63	3.88%	OK	OK	OK	2.22%	-2.70%	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	3,966,596.00	3.02%		139,983,802.39	2.83%	OK	OK	OK	1.36%	-	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	7,579,063.80	5.77%		141,913,762.93	5.34%	OK	OK	OK	2.90%	-6.07%	-6.25%	-	-	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	2,880,365.30	2.19%		1,749,553,992.46	0.16%	OK	OK	OK	2.66%	3.28%	7.94%	13.91%	12.71%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>605,804.27</b>	<b>0.46%</b>	<b>15.00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	605,804.27	0.46%		86,655,586.79	0.70%	OK	OK	OK	2.64%	1.19%	5.23%	11.26%	10.81%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>17,282,853.55</b>	<b>13.16%</b>	<b>30.00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	10,628,817.09	8.09%		227,971,221.35	4.66%	OK	OK	OK	1.35%	-1.53%	0.62%	5.83%	5.64%	
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	997,185.81	0.76%		893,112,662.82	0.11%	OK	OK	OK	1.03%	3.14%	6.31%	11.90%	10.05%	
BTG PACTUAL NTNB FI RENDA FIXA	1,712,290.80	1.30%		135,332,347.64	1.27%	OK	OK	OK	1.18%	3.00%	3.78%	9.68%	10.63%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	3,490,737.00	2.66%		1,166,750,099.78	0.30%	OK	OK	OK	1.18%	0.12%	3.86%	9.89%	7.63%	
CAIXA FI BRASIL DI LP	453,822.85	0.35%		3,995,910,673.01	0.01%	OK	OK	OK	1.11%	3.40%	6.78%	12.87%	10.86%	
<b>FIDC</b>	<b>3,529,289.11</b>	<b>2.69%</b>	<b>5.00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	3,529,289.11	2.69%		279,130,893.96	1.26%	OK	OK	OK	1.27%	3.87%	7.77%	14.80%	12.47%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>4,762,198.31</b>	<b>3.63%</b>	<b>5.00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC ITALIA SEN	73,770.82	0.06%		83,682,340.66	0.09%	OK	OK	OK	-0.73%	-3.40%	26.82%	-2.39%	25.05%	
FIDC MULTI SILVERADO MAXIMUM 7 SERIE	2,368,972.19	1.80%		88,913,692.00	2.66%	OK	OK	OK	1.44%	4.39%	8.83%	16.89%	14.21%	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III SENIOR	6,389.71	0.00%		4,697,898.22	0.14%	OK	OK	OK	-3.63%	-12.70%	-22.28%	-47.59%	-44.86%	
RURAL FIDC PREMIUM SENIOR	2,313,065.59	1.76%		122,051,911.50	1.90%	OK	OK	OK	1.11%	3.25%	8.21%	17.65%	15.30%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>4,927,535.27</b>	<b>3.75%</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	2,823,080.74	2.15%		272,826,330.33	1.03%	OK	OK	OK	1.79%	-0.25%	3.09%	9.29%	8.34%	
BB RPPS RF CRED PRIV IPCA II FI	480,366.11	0.37%		79,968,147.61	0.60%	OK	OK	OK	2.37%	4.00%	8.71%	15.23%	14.35%	
CAIXA FI BRASIL IPCA IX RF CRED PRIV	1,358,618.87	1.03%		92,448,489.90	1.47%	OK	OK	OK	1.12%	2.83%	6.52%	15.55%	13.28%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	265,469.55	0.20%		97,824,669.70	0.27%	OK	OK	OK	1.06%	2.85%	6.50%	15.35%	13.23%	

# ENQUADRAMENTO LEGAL



ITU

10/30/2015

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	
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>131,335,993.64</b>	<b>100.00%</b>	<b>130.00%</b>							<b>1.54%</b>	<b>-1.04%</b>	<b>1.01%</b>	<b>6.52%</b>	<b>6.59%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>1.26%</b>	<b>3.03%</b>	<b>7.00%</b>	<b>16.95%</b>	<b>14.50%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1.31%</b>	<b>3.08%</b>	<b>6.86%</b>	<b>16.53%</b>	<b>13.92%</b>
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>4,413,964.70</b>	<b>3.36%</b>	<b>3.00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso I</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	1,051,781.88	0.80%		24,176,628.58	4.35%	OK	OK	OK	1.29%	-6.44%	-10.27%	-7.62%	-3.12%	-0.85%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	2,026,825.35	1.54%		34,388,394.79	5.89%	OK	OK	OK	1.27%	-10.14%	-18.60%	-8.31%	-15.69%	-9.81%
GERACAO FIA PROGRAMADO	1,335,357.47	1.02%		502,928,607.02	0.27%	OK	OK	OK	-0.60%	-4.93%	-4.49%	-4.49%	-5.69%	-0.91%
<b>Fundos de Ações</b>	<b>14,836,612.61</b>	<b>11.30%</b>	<b>14.00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB ACOES PIPE FC	324,046.17	0.25%		76,247,380.83	0.42%	OK	OK	OK	0.31%	-6.81%	-7.62%	-7.62%	-3.12%	-0.85%
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FC	302,271.19	0.23%		44,041,173.89	0.69%	OK	OK	OK	1.10%	-7.58%	-12.94%	-12.94%	-6.50%	-1.45%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	4,468,899.67	3.40%		1,452,422,146.28	0.31%	OK	OK	OK	-1.66%	-8.41%	-8.31%	-8.31%	0.39%	3.13%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	1,943,855.54	1.48%		608,223,190.53	0.32%	OK	OK	OK	1.87%	-6.87%	-9.69%	-9.69%	-0.31%	1.46%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	323,513.04	0.25%		301,471,481.76	0.11%	OK	OK	OK	4.24%	-4.26%	-5.75%	-5.75%	-4.91%	-5.26%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	246,458.19	0.19%		156,325,528.24	0.16%	OK	OK	OK	2.86%	-5.20%	-9.96%	-9.96%	-18.52%	-15.63%
GERACAO FIA	2,674,633.10	2.04%		137,820,893.21	1.94%	OK	OK	OK	-0.43%	-4.48%	-4.01%	-4.01%	-5.07%	-0.37%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2,381,870.68	1.81%		270,452,029.56	0.88%	OK	OK	OK	-0.62%	-5.86%	-4.41%	-4.41%	-6.62%	-1.03%
LEGAN CAPSE FI ACOES	844,291.74	0.64%		31,961,480.62	2.64%	OK	OK	OK	1.30%	-11.95%	-17.38%	-17.38%	-22.20%	-13.45%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	1,326,773.29	1.01%		100,935,498.54	1.31%	OK	OK	OK	3.85%	2.01%	-0.48%	-0.48%	-7.03%	-3.45%
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>7,113,665.84</b>	<b>5.42%</b>	<b>5.00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso IV</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Desenquadrado</b>	
BTG PACT CRE COR I FIC FI MULT CRED PRIV	3,416,925.65	2.60%		2,004,934,824.85	0.17%	OK	OK	OK	1.18%	3.61%	7.24%	7.24%	13.81%	11.66%
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	650,057.16	0.49%		212,530,105.51	0.31%	OK	OK	OK	-0.58%	1.91%	6.56%	6.56%	14.03%	11.08%
VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI	1,971,867.77	1.50%		129,918,600.72	1.52%	OK	OK	OK	1.82%	1.17%	5.25%	5.25%	12.01%	10.63%
WA US INDEX 500 FI MULTI	1,074,815.26	0.82%		199,429,544.83	0.54%	OK	OK	OK	9.39%	1.93%	6.10%	6.10%	15.69%	10.23%
<b>Fundos de Participações</b>	<b>1,739,658.04</b>	<b>1.32%</b>	<b>4.00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	242,841.21	0.18%		182,041,238.60	0.13%	OK	OK	OK	-23.12%	-23.94%	-22.20%	-22.20%	-35.56%	-37.93%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP*	589,689.36	0.45%		-	-	OK	OK	OK	-	-	-	-	-	-
FIP BRASIL OLEO & GAS FI EM PARTICIP	319,807.63	0.24%		79,951,907.36	0.40%	OK	OK	OK	-47.29%	-47.52%	-47.95%	-47.95%	-48.71%	-48.42%
FIP INFRA BB VOT ENERG SUST II CLASSE A	587,319.84	0.45%		148,524,378.24	0.40%	OK	OK	OK	0.94%	3.02%	6.54%	6.54%	14.62%	8.30%
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>1,584,026.54</b>	<b>1.21%</b>	<b>4.00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND**	342,647.76	0.26%		2,998,112,449.53	0.01%	OK	OK	OK	0.42%	1.11%	-0.81%	-0.81%	-0.45%	0.61%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY**	1,241,378.78	0.95%		141,540,656.60	0.88%	OK	OK	OK	1.71%	2.00%	0.08%	0.08%	19.12%	20.13%

- 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 18/11/2015 às 10:00 hrs.