

ENQUADRAMENTO LEGAL



ITU

30/11/2015

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	132.199.420,31	100,00%	130,00%							0,40%	2,01%	0,54%	5,28%	7,02%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,60%	3,91%	7,13%	17,63%	16,33%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,50%	3,89%	7,14%	17,10%	15,64%
Fundos que contenham somente títulos públicos	73.086.113,88	55,28%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 20 TIT PUBL FI	2.282.761,81	1,73%		67.750.590,47	3,37%	OK	OK	OK	1,50%	2,44%	-8,17%	-1,99%	2,31%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	6.986.056,88	5,28%		966.331.227,36	0,72%	OK	OK	OK	0,56%	3,36%	5,17%	11,58%	12,22%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	5.077.274,99	3,84%		264.952.778,45	1,92%	OK	OK	OK	0,75%	-	-	-	-	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL VII FI	21.637.874,64	16,37%		1.925.884.328,96	1,12%	OK	OK	OK	0,74%	3,55%	5,11%	-	-	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.087.382,04	3,85%		37.328.144,14	13,63%	OK	OK	OK	1,05%	-	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	1.579.467,00	1,19%		797.645.273,78	0,20%	OK	OK	OK	0,95%	4,52%	4,93%	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	13.859.384,00	10,48%		374.535.814,05	3,70%	OK	OK	OK	0,43%	2,11%	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	4.023.992,00	3,04%		142.009.470,17	2,83%	OK	OK	OK	1,45%	1,40%	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	7.661.461,50	5,80%		145.143.391,49	5,28%	OK	OK	OK	1,09%	1,57%	-8,15%	-	-	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	4.890.459,02	3,70%		1.906.903.106,29	0,26%	OK	OK	OK	0,51%	3,92%	6,49%	13,34%	13,27%	
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	607.656,90	0,46%	15,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	607.656,90	0,46%		86.920.589,87	0,70%	OK	OK	OK	0,31%	2,91%	3,42%	10,71%	11,15%	
Fundos de Renda Fixa (Normal)	16.471.425,58	12,46%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	10.406.120,63	7,87%		223.194.736,62	4,66%	OK	OK	OK	0,84%	1,17%	-0,32%	4,95%	6,53%	
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	284.988,47	0,22%		839.985.668,09	0,03%	OK	OK	OK	1,00%	3,16%	6,39%	12,17%	11,16%	
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	100.000,00	0,08%		5.898.203.717,69	0,00%	OK	OK	OK	1,06%	3,39%	6,88%	13,27%	12,14%	
BTG PACTUAL NTN B FI RENDA FIXA	1.685.231,25	1,27%		133.193.670,64	1,27%	OK	OK	OK	-1,58%	0,45%	4,04%	10,20%	8,88%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	3.536.487,00	2,68%		1.181.993.378,29	0,30%	OK	OK	OK	1,31%	3,41%	7,06%	16,88%	15,47%	
CAIXA FI BRASIL DI LP	458.598,23	0,35%		3.944.280.987,80	0,01%	OK	OK	OK	1,05%	3,37%	6,86%	13,10%	12,02%	
FIDC	3.572.147,40	2,70%	5,00%			Art. 7o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	3.572.147,40	2,70%		276.803.543,22	1,29%	OK	OK	OK	1,21%	3,87%	7,86%	15,09%	13,84%	
FIDC Fechado	4.187.380,79	3,17%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC ITALIA SEN	71.643,56	0,05%		81.131.166,96	0,09%	OK	OK	OK	-3,05%	-5,72%	27,98%	21,05%	21,24%	
FIDC MULTI SILVERADO MAXIMUM 7 SERIE	1.801.137,59	1,36%		67.601.382,05	2,66%	OK	OK	OK	-23,97%	-21,71%	-18,30%	-12,09%	-13,17%	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III SENIOR	6.006,18	0,00%		4.415.922,29	0,14%	OK	OK	OK	-6,00%	-13,52%	-24,08%	-49,92%	-48,17%	
RURAL FIDC PREMIUM SENIOR	2.308.593,46	1,75%		121.815.933,70	1,90%	OK	OK	OK	1,56%	3,96%	8,73%	18,52%	17,10%	
Fundo Crédito Privado	5.474.076,25	4,14%	5,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVID RF CRED PRIV IPCA III FI	2.845.891,25	2,15%		275.030.768,50	1,03%	OK	OK	OK	0,81%	1,89%	2,20%	8,92%	9,22%	
BB RPPS RF CRED PRIV IPCA II FI	483.708,13	0,37%		80.524.504,95	0,60%	OK	OK	OK	0,70%	3,95%	7,44%	14,90%	15,15%	
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	500.000,00	0,38%		2.124.950.497,29	0,02%	OK	OK	OK	1,08%	3,45%	6,97%	13,32%	12,22%	
CAIXA FI BRASIL IPCA IX RF CRED PRIV	1.375.787,57	1,04%		93.616.732,39	1,47%	OK	OK	OK	1,26%	3,29%	6,77%	16,03%	14,71%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	268.689,30	0,20%		99.011.136,55	0,27%	OK	OK	OK	1,21%	3,08%	6,59%	15,78%	14,60%	


ITU
30/11/2015

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	132.199.420,31	100,00%	130,00%							0,40%	2,01%	0,54%	5,28%	7,02%
META ATUARIAL (INPC + 6%)										1,60%	3,91%	7,13%	17,63%	16,33%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										1,50%	3,89%	7,14%	17,10%	15,64%
Fundos de Ações Referenciados	4.427.174,98	3,35%	3,00%			Art. 8o, Inciso I						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	1.045.178,01	0,79%		24.024.827,40	4,35%	OK	OK	OK	-0,63%	-2,65%	-7,38%	-6,78%	-3,12%	
CAIXA FIA BRASIL IOVESPA	2.009.477,48	1,52%		34.094.073,77	5,89%	OK	OK	OK	-0,86%	-4,02%	-14,15%	-17,56%	-10,58%	
GERACAO FIA PROGRAMADO	1.372.519,49	1,04%		512.942.417,54	0,27%	OK	OK	OK	2,78%	3,97%	1,57%	-5,79%	1,85%	
Fundos de Ações	14.862.145,64	11,24%	14,00%			Art. 8o, Inciso III						Alocação:	Enquadrado	
BB ACOES PIPE FC	317.082,84	0,24%		74.540.905,48	0,43%	OK	OK	OK	-2,15%	-5,46%	-9,17%	-6,78%	-2,99%	
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCAÇÃO FC	301.443,23	0,23%		43.939.585,60	0,69%	OK	OK	OK	-0,27%	-1,80%	-9,16%	-8,14%	-1,72%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	4.375.474,42	3,31%		1.444.220.839,65	0,30%	OK	OK	OK	-2,09%	-6,37%	-7,65%	-4,51%	0,98%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	1.912.900,96	1,45%		582.076.854,38	0,33%	OK	OK	OK	-1,59%	-3,46%	-7,83%	-4,90%	-0,16%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	330.086,85	0,25%		307.597.415,48	0,11%	OK	OK	OK	2,03%	3,81%	-3,73%	-3,84%	-3,33%	
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	249.336,97	0,19%		158.151.587,21	0,16%	OK	OK	OK	1,17%	1,28%	-5,25%	-16,88%	-14,65%	
GERACAO FIA	2.748.783,45	2,08%		138.319.907,39	1,99%	OK	OK	OK	2,77%	4,28%	2,11%	-5,13%	2,39%	
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.453.169,45	1,86%		277.022.001,60	0,89%	OK	OK	OK	2,99%	3,15%	1,35%	-6,71%	1,94%	
LEGAN CAPSE FI ACOES	833.317,52	0,63%		31.457.200,34	2,65%	OK	OK	OK	-1,30%	-5,33%	-14,70%	-21,78%	-14,58%	
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	1.340.549,95	1,01%		98.656.244,61	1,36%	OK	OK	OK	1,04%	6,07%	2,47%	-6,40%	-2,45%	
Fundos Multimercados	6.187.603,84	4,68%	5,00%			Art. 8o, Inciso IV						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACT CRE COR I FIC FI MULT CRED PRIV	2.449.429,16	1,85%		1.958.624.722,09	0,13%	OK	OK	OK	1,11%	3,58%	7,30%	14,05%	12,90%	
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	659.882,24	0,50%		208.572.662,25	0,32%	OK	OK	OK	1,51%	2,90%	7,05%	13,57%	12,76%	
VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI	1.988.772,76	1,50%		130.917.330,92	1,52%	OK	OK	OK	0,86%	2,87%	4,56%	11,94%	11,58%	
WA US INDEX 500 FI MULTI	1.089.519,68	0,82%		196.079.706,00	0,56%	OK	OK	OK	1,37%	7,95%	5,28%	13,37%	11,74%	
Fundos de Participações	1.739.643,53	1,32%	4,00%			Art. 8o, Inciso V						Alocação:	Enquadrado	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	241.241,81	0,18%		180.842.282,00	0,13%	OK	OK	OK	-0,66%	-24,06%	-22,31%	-35,80%	-38,34%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP*	585.645,72	0,44%				OK	OK	OK	-	-	-	-	-	
FIP BRASIL OLEO & GAS FI EM PARTICIP	318.503,24	0,24%		79.642.871,36	0,40%	OK	OK	OK	-0,41%	-47,63%	-48,03%	-48,79%	-48,63%	
FIP INFRA BB VOT ENERG SUST II CLASSE A	594.252,76	0,45%		150.277.608,32	0,40%	OK	OK	OK	1,18%	3,18%	6,58%	14,91%	9,58%	
Fundos de Investimento Imobiliários	1.584.051,52	1,20%	4,00%			Art. 8o, Inciso VI						Alocação:	Enquadrado	
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND**	326.482,68	0,25%		2.998.112.449,53	0,01%	OK	OK	OK	-0,23%	-1,86%	-4,66%	-5,70%	-4,25%	
KINEA II REAL ESTATE EQUITY**	1.257.568,84	0,95%		153.674.509,32	0,82%	OK	OK	OK	2,17%	4,29%	3,97%	22,22%	22,74%	

- 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 18/12/2015 às 10:00 hrs.