

# ENQUADRAMENTO LEGAL



ITU

31/12/2015

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>135.406.481,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>130,00%</b>							<b>2,21%</b>	<b>4,20%</b>	<b>2,12%</b>	<b>9,38%</b>	<b>9,38%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>1,39%</b>	<b>4,31%</b>	<b>7,27%</b>	<b>17,95%</b>	<b>17,95%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,45%</b>	<b>4,32%</b>	<b>7,32%</b>	<b>17,31%</b>	<b>17,31%</b>
<b>Fundos que contenham somente títulos públicos</b>	<b>75.644.427,33</b>	<b>55,86%</b>	<b>40,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	7.139.413,63	5,27%		987.543.968,90	0,72%	OK	OK	OK	2,20%	5,37%	6,79%	14,68%	14,68%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	8.525.539,42	6,30%		295.326.021,78	2,89%	OK	OK	OK	2,60%	-	-	-	-	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB VII FI	22.083.152,81	16,31%		1.965.516.421,82	1,12%	OK	OK	OK	2,06%	5,13%	6,67%	-	-	
BTG PACT 2024 TIT PUBLICOS FI RENDA FIXA	5.208.623,15	3,85%		38.217.737,78	13,63%	OK	OK	OK	2,38%	-	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2016 II TP RF	1.605.829,50	1,19%		810.958.856,25	0,20%	OK	OK	OK	1,67%	4,75%	5,44%	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2020 IV TP RF	14.230.188,00	10,51%		417.078.698,97	3,41%	OK	OK	OK	2,68%	5,41%	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	4.116.892,00	3,04%		145.287.908,31	2,83%	OK	OK	OK	2,31%	5,20%	-	-	-	
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	7.748.317,50	5,72%		151.030.910,42	5,13%	OK	OK	OK	1,13%	5,19%	-6,26%	-	-	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	4.986.471,32	3,68%		2.427.609.953,99	0,21%	OK	OK	OK	1,96%	5,21%	7,68%	15,50%	15,50%	
<b>Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA</b>	<b>619.552,77</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	619.552,77	0,46%		151.448.045,07	0,41%	OK	OK	OK	1,96%	4,96%	4,98%	13,32%	13,32%	
<b>Fundos de Renda Fixa ( Normal )</b>	<b>16.873.517,09</b>	<b>12,46%</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	10.689.833,96	7,89%		229.279.936,00	4,66%	OK	OK	OK	2,73%	4,98%	2,55%	9,43%	9,43%	
BB RPPS RENDA FIXA FLUXO FIC FI	310.956,05	0,23%		1.020.727.607,67	0,03%	OK	OK	OK	1,08%	3,16%	6,47%	12,36%	12,36%	
BB RPPS RENDA FIXA PERFIL FIC FI	101.180,59	0,07%		5.926.736.811,87	0,00%	OK	OK	OK	1,18%	3,39%	6,98%	13,46%	13,46%	
BTG PACTUAL NTNB FI RENDA FIXA	1.712.967,00	1,27%		135.385.788,22	1,27%	OK	OK	OK	1,65%	1,22%	4,33%	10,68%	10,68%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	3.594.678,00	2,65%		1.201.441.819,28	0,30%	OK	OK	OK	1,65%	4,19%	7,36%	17,37%	17,37%	
CAIXA FI BRASIL DI LP	463.901,49	0,34%		4.154.681.902,24	0,01%	OK	OK	OK	1,16%	3,36%	6,95%	13,32%	13,32%	
<b>FIDC</b>	<b>3.619.892,88</b>	<b>2,67%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
OURINVEST FIDC FINANC SUPPLIER SENIOR 1	3.619.892,88	2,67%		280.503.311,75	1,29%	OK	OK	OK	1,34%	3,87%	7,98%	15,36%	15,36%	
<b>FIDC Fechado</b>	<b>4.247.602,01</b>	<b>3,14%</b>	<b>5,00%</b>			<b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FIDC ITALIA SEN	79.176,83	0,06%		89.662.052,23	0,09%	OK	OK	OK	10,51%	6,37%	42,74%	33,99%	33,99%	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III SENIOR	5.951,78	0,00%		4.375.919,18	0,14%	OK	OK	OK	-0,91%	-10,24%	-21,13%	-48,64%	-48,64%	
RURAL FIDC PREMIUM SENIOR	2.334.099,04	1,72%		123.161.768,60	1,90%	OK	OK	OK	5,19%	8,02%	11,65%	23,18%	23,18%	
FIDC MULTI SILVERADO MAXIMUM 7 SERIE	1.828.374,36	1,35%		68.623.648,43	2,66%	OK	OK	OK	1,51%	-21,71%	-18,20%	-11,85%	-11,85%	
<b>Fundo Crédito Privado</b>	<b>5.589.348,15</b>	<b>4,13%</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	2.921.052,00	2,16%		282.294.404,52	1,03%	OK	OK	OK	2,64%	5,32%	4,63%	12,10%	12,10%	
BB RPPS RF CRED PRIV IPCA II FI	492.283,95	0,36%		81.952.149,80	0,60%	OK	OK	OK	1,77%	4,91%	8,34%	17,19%	17,19%	
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	505.926,14	0,37%		2.443.328.287,32	0,02%	OK	OK	OK	1,19%	3,42%	7,08%	13,55%	13,55%	
CAIXA FI BRASIL IPCA IX RF CRED PRIV	1.397.416,51	1,03%		95.088.513,20	1,47%	OK	OK	OK	1,57%	4,01%	7,05%	16,52%	16,52%	
CAIXA FI BRASIL IPCA XIII RF CRED PRIV	272.669,55	0,20%		100.477.815,34	0,27%	OK	OK	OK	1,48%	3,80%	6,90%	16,30%	16,30%	

# ENQUADRAMENTO LEGAL



ITU

31/12/2015

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>135.406.481,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>130,00%</b>							<b>2,21%</b>	<b>4,20%</b>	<b>2,12%</b>	<b>9,38%</b>	<b>9,38%</b>
META ATUARIAL ( INPC + 6%)										<b>1,39%</b>	<b>4,31%</b>	<b>7,27%</b>	<b>17,95%</b>	<b>17,95%</b>
META ATUARIAL ( IPCA + 6%)										<b>1,45%</b>	<b>4,32%</b>	<b>7,32%</b>	<b>17,31%</b>	<b>17,31%</b>
<b>Fundos de Ações Referenciados</b>	<b>4.316.278,54</b>	<b>3,19%</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	1.030.513,26	0,76%		8.952.476,40	11,51%	OK	OK	OK	-1,40%	-0,75%		-9,64%	-4,48%	-4,48%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	1.928.932,46	1,42%		32.727.481,55	5,89%	OK	OK	OK	-4,01%	-3,62%		-17,94%	-14,17%	-14,17%
GERACAO FIA PROGRAMADO	1.356.832,82	1,00%		501.729.173,51	0,27%	OK	OK	OK	-1,14%	1,00%		-0,94%	0,69%	0,69%
<b>Fundos de Ações</b>	<b>14.535.069,50</b>	<b>10,73%</b>	<b>14,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso III</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BB ACOES PIPE FC	311.714,59	0,23%		73.278.919,21	0,43%	OK	OK	OK	-1,69%	-3,51%		-11,51%	-4,63%	-4,63%
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FC	291.170,22	0,22%		38.407.827,43	0,76%	OK	OK	OK	-3,41%	-2,61%		-13,90%	-5,07%	-5,07%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	4.281.840,28	3,16%		939.279.255,50	0,46%	OK	OK	OK	-2,14%	-5,78%		-11,72%	-1,18%	-1,18%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FI ACOES	1.873.699,45	1,38%		359.283.844,93	0,52%	OK	OK	OK	-2,05%	-1,81%		-11,49%	-2,20%	-2,20%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	330.464,07	0,24%		307.949.066,22	0,11%	OK	OK	OK	0,11%	6,48%		-3,27%	-3,22%	-3,22%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	254.880,56	0,19%		161.667.708,54	0,16%	OK	OK	OK	2,22%	6,37%		0,46%	-12,75%	-12,75%
GERACAO FIA	2.716.096,19	2,01%		136.303.648,74	1,99%	OK	OK	OK	-1,19%	1,11%		-0,49%	1,17%	1,17%
GERACAO FUTURO DIVIDENDOS FIA	2.376.980,45	1,76%		265.627.945,19	0,89%	OK	OK	OK	-3,11%	-0,82%		-3,03%	-1,23%	-1,23%
LEGAN CAPSE FI ACOES	812.897,17	0,60%		30.489.477,57	2,67%	OK	OK	OK	-2,45%	-2,47%		-17,70%	-16,67%	-16,67%
QUEST SMALL CAPS FIC FI DE ACOES	1.285.326,52	0,95%		93.313.248,81	1,38%	OK	OK	OK	-4,12%	0,60%		-0,67%	-6,47%	-6,47%
<b>Fundos Multimercados</b>	<b>6.270.818,50</b>	<b>4,63%</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	2.478.800,08	1,83%		1.924.074.434,19	0,13%	OK	OK	OK	1,20%	3,53%		7,36%	14,26%	14,26%
GERACAO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	669.014,51	0,49%		206.117.878,11	0,32%	OK	OK	OK	1,38%	2,32%		7,35%	14,32%	14,32%
VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI	2.030.104,99	1,50%		133.755.621,89	1,52%	OK	OK	OK	2,08%	4,83%		5,84%	13,90%	13,90%
WA US INDEX 500 FI MULTI	1.092.898,92	0,81%		188.384.804,92	0,58%	OK	OK	OK	0,31%	11,23%		6,65%	12,08%	12,08%
<b>Fundos de Participações</b>	<b>2.109.007,70</b>	<b>1,56%</b>	<b>4,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso V</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	602.802,02	0,45%		451.878.928,00	0,13%	OK	OK	OK	149,87%	90,84%		95,25%	54,08%	54,08%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FIC DE FIP	580.961,28	0,43%		299.188.562,87	0,19%	OK	OK	OK	0,08%	-		-	-	-
FIP BRASIL OLEO & GAS FI EM PARTICIP	321.179,86	0,24%		80.294.964,65	0,40%	OK	OK	OK	0,24%	-47,38%		-47,76%	-48,51%	-48,51%
FIP INFRA BB VOT ENERG SUST II CLASSE A	604.064,54	0,45%		152.758.860,06	0,40%	OK	OK	OK	1,65%	3,82%		7,19%	11,39%	11,39%
<b>Fundos de Investimento Imobiliários</b>	<b>1.580.057,78</b>	<b>1,17%</b>	<b>4,00%</b>			<b>Art. 8o, Inciso VI</b>						<b>Alocação:</b>	<b>Enquadrado</b>	
FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	304.247,58	0,22%		2.872.923.321,24	0,01%	OK	OK	OK	-4,17%	-4,63%		-5,96%	-8,25%	-8,25%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY	1.276.719,08	0,94%		220.135.880,26	0,58%	OK	OK	OK	4,40%	8,49%		9,16%	28,14%	28,14%

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.