



JOINVILLE

31/01/2018

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	VaR %	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades						
								RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano		
CONSOLIDADO	2.175.291.365,87	100,00%	198,00%													
META ATUARIAL (INPC + 6%)											2,79%	3,82%	6,64%	15,61%	2,79%	
META ATUARIAL (IPCA + 6%)											0,74%	2,13%	3,98%	7,91%	0,74%	
											0,80%	2,47%	4,80%	8,95%	0,80%	
Títulos Públicos	858.876.292,88	39,48%	50,00%				Art. 7º, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - BRADESCO	418.179.676,25	19,22%		-		1,88%	-	-	-	1,70%	2,81%	5,73%	14,39%	1,70%		
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - BANCO DO BRASIL	382.684.874,66	17,59%		-		1,71%	-	-	-	1,52%	2,65%	5,42%	13,59%	1,52%		
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - XP INVESTIMENTOS	58.011.741,97	2,67%		-		3,64%	-	-	-	3,01%	3,65%	6,42%	15,32%	3,01%		
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham somente títulos públicos	757.021.911,66	34,80%	50,00%				Art. 7º, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	107.121,50	0,00%		1.250.937.272,81	0,01%	0,02%	OK	OK	OK	0,49%	1,42%	3,28%	8,30%	0,49%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	223.354.348,38	10,27%		4.728.171.648,25	4,72%	3,60%	OK	OK	OK	3,38%	3,41%	6,22%	14,22%	3,38%		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5 FI	137.787.386,38	6,33%		998.545.448,52	13,80%	5,05%	OK	OK	OK	4,92%	4,19%	6,96%	15,19%	4,92%		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA II FI	10.403.153,60	0,48%		863.397.145,59	1,20%	1,05%	OK	OK	OK	1,03%	1,82%	4,38%	11,77%	1,03%		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA III FI	13.426.320,73	0,62%		1.067.358.823,11	1,26%	0,02%	OK	OK	OK	1,09%	2,64%	5,10%	9,46%	1,09%		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	14.406.398,88	0,66%		290.566.855,14	4,96%	2,96%	OK	OK	OK	2,18%	2,68%	5,72%	14,43%	2,18%		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	14.868.679,12	0,68%		405.661.844,15	3,67%	2,69%	OK	OK	OK	1,82%	2,78%	5,72%	14,62%	1,82%		
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	867.652,51	0,04%		364.006.432,77	0,24%	0,51%	OK	OK	OK	1,04%	1,61%	3,84%	10,22%	1,04%		
BTG PACTUAL NTN B FI RF	25.427.814,00	1,17%		150.728.158,65	16,87%	0,00%	OK	OK	Desenquadrado	1,06%	-0,27%	2,05%	3,27%	1,06%		
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	26.662.100,00	1,23%		1.336.682.662,13	1,99%	0,00%	OK	OK	OK	1,06%	2,61%	4,99%	6,10%	1,06%		
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	29.511.840,00	1,36%		394.351.398,82	7,48%	3,11%	OK	OK	OK	3,05%	2,77%	3,21%	8,77%	3,05%		
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3.269.782,17	0,15%		4.436.820.202,65	0,07%	1,43%	OK	OK	OK	0,95%	2,06%	4,74%	12,22%	0,95%		
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	78.091.668,12	3,59%		918.920.726,37	8,50%	5,01%	OK	OK	OK	4,91%	4,20%	6,98%	15,45%	4,91%		
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	57.665,24	0,00%		2.759.142.861,03	0,00%	1,54%	OK	OK	OK	1,37%	2,66%	5,19%	13,75%	1,37%		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	17.975.305,21	0,83%		6.740.982.774,06	0,27%	1,77%	OK	OK	OK	3,31%	2,28%	5,06%	12,57%	1,31%		
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	85.258.488,88	3,92%		4.249.583.705,83	2,01%	3,61%	OK	OK	OK	3,37%	3,39%	6,21%	14,24%	3,37%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	33.117.154,24	1,52%		1.750.421.752,55	1,89%	1,77%	OK	OK	OK	1,30%	2,23%	4,95%	12,33%	1,30%		
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	42.429.032,70	1,95%		482.030.471,18	8,80%	3,59%	OK	OK	OK	3,36%	3,35%	6,11%	13,98%	3,36%		
Fundos de índice Renda fixa que contenham somente títulos públicos							Art. 7º, Inciso I, Alínea C						Alocação:			
Operações Compromissadas			5,00%				Art. 7º, Inciso II						Alocação:			
Fundos Referenciados Renda Fixa			25,00%				Art. 7º, Inciso III, Alínea A						Alocação:			
Fundos Índice Renda Fixa							Art. 7º, Inciso III, Alínea B						Alocação:			
Fundos Renda Fixa - DI	385.337.794,12	17,71%	20,00%				Art. 7º, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	52.672.267,89	2,42%		2.196.083.459,89	2,40%	1,77%	OK	OK	OK	1,31%	2,28%	5,06%	12,61%	1,31%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	89.014,38	0,00%		4.094.151.480,10	0,00%	0,02%	OK	OK	OK	0,57%	1,73%	3,90%	9,51%	0,57%		
BRADESCO FI RF REF DI PREMIUM	22.120.091,07	1,02%		9.348.518.776,52	0,24%	0,01%	OK	OK	OK	0,57%	1,67%	4,03%	9,79%	0,57%		
BRADESCO INST FICFI RF IMA B	177.324.219,75	8,15%		1.445.928.639,25	12,26%	3,70%	OK	OK	OK	3,39%	3,41%	6,32%	14,58%	3,39%		
BRADESCO INST FICFI RF IMA GERAL	57.699.828,99	2,65%		737.134.158,81	7,83%	1,78%	OK	OK	OK	1,81%	2,67%	5,24%	12,95%	1,81%		
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	12.958,65	0,00%		539.154.498,52	0,00%	0,00%	OK	OK	OK	0,51%	1,49%	3,41%	8,50%	0,51%		
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	6.097.165,18	0,28%		6.349.465.352,27	0,10%	0,01%	OK	OK	OK	0,57%	1,66%	3,78%	9,39%	0,57%		
ITAU INST ALOCAÇÃO DINAMICA II RF FICFI	5.870.719,70	0,27%		902.047.888,80	0,65%	1,57%	OK	OK	OK	1,49%	2,43%	5,24%	12,16%	1,49%		
ITAU INST ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	63.451.528,51	2,92%		1.473.930.062,00	4,30%	1,57%	OK	OK	OK	1,49%	2,43%	5,24%	12,18%	1,49%		
Fundos de Índice Renda Fixa - DI							Art. 7º, Inciso IV, Alínea B						Alocação:			
Letras Imobiliárias Garantidas							Art. 7º, Inciso V						Alocação:			
Certificado de Depósito Bancário (CDB)							Art. 7º, Inciso VI, Alínea A						Alocação:			
Depósito Poupança							Art. 7º, Inciso VI, Alínea B						Alocação:			
FIDC Cota Sênior	1.532.273,75	0,07%	1,00%				Art. 7º, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado		
FIDC ITALIA SEN	1.468.754,01	0,07%		32.685.455,57	4,49%	-	OK	OK	OK	101,69%	195,92%	205,28%	1209,03%	101,69%		
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III SENIOR	63.519,74	0,00%		1.811.896,56	3,51%	-	OK	OK	OK	-92,78%	4,95%	-5,77%	-29,82%	-92,78%		
Fundos Crédito Privado	4.380.524,31	0,20%	2,00%				Art. 7º, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado		
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	4.207.230,00	0,19%		229.720.676,54	1,83%	0,23%	OK	OK	OK	0,99%	1,75%	3,68%	9,48%	0,99%		
SANTOS CREDIT YIELD FI RF CP	173.294,31	0,01%		12.160.379,08	1,43%	0,87%	OK	OK	OK	0,25%	-0,11%	6,90%	-20,11%	0,25%		
Fundos Lei nº12.431							Art. 7º, Inciso VII, Alínea C						Alocação:			

ENQUADRAMENTO LEGAL



JOINVILLE

31/01/2018

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	VaR %	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades					
								RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano	
CONSOLIDADO	2.175.291.365,87	100,00%	198,00%								2,79%	3,82%	6,64%	15,61%	2,79%
META ATUARIAL (INPC + 6%)											0,74%	2,13%	3,98%	7,91%	0,74%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)											0,80%	2,47%	4,80%	8,95%	0,80%
Fundos de Ações Referenciados	62.445.295,77	2,87%	15,00%				Art. 8º, Inciso I, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB ACOES IBRX INDEXADO FC FI	7.493.104,49	0,34%		160.498.109,73	4,67%	9,81%	OK	OK	OK	10,49%	13,09%	26,13%	28,53%	28,53%	10,49%
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	7.570.902,81	0,35%		89.490.030,28	8,46%	10,03%	OK	OK	OK	11,11%	14,08%	28,34%	30,78%	30,78%	11,11%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	47.381.288,47	2,18%		790.308.523,67	6,00%	9,61%	OK	OK	OK	9,71%	11,96%	24,27%	29,60%	29,60%	9,71%
Fundos de índices de Renda Variável							Art. 8º, Inciso I, Alínea B							Alocação:	
Fundos de Ações	64.319.196,68	2,96%	15,00%				Art. 8º, Inciso II, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB ACOES DIVIDENDOS FC FI	7.100.278,14	0,33%		446.071.215,89	1,59%	8,46%	OK	OK	OK	10,03%	10,35%	19,43%	23,99%	23,99%	10,03%
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	4.990.186,57	0,23%		212.712.882,80	2,35%	8,79%	OK	OK	OK	8,13%	10,60%	22,82%	30,37%	30,37%	8,13%
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	15.591.854,56	0,72%		1.148.504.253,09	1,36%	9,41%	OK	OK	OK	11,32%	14,19%	24,94%	31,94%	31,94%	11,32%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	7.269.641,47	0,33%		364.884.519,37	1,99%	7,34%	OK	OK	OK	5,71%	7,79%	19,06%	23,08%	23,08%	5,71%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.597.698,94	0,35%		114.980.001,85	6,61%	9,63%	OK	OK	OK	5,80%	9,51%	23,75%	34,00%	34,00%	5,80%
KINEA PIPE FI EM ACOES	11.251.916,71	0,52%		267.992.246,53	4,20%	10,71%	OK	OK	OK	2,67%	3,66%	15,85%	34,88%	34,88%	2,67%
SUL AMERICA TOTAL RETURN FIA	10.517.620,29	0,48%		103.938.057,53	10,12%	10,97%	OK	OK	OK	11,14%	12,49%	25,81%	37,77%	37,77%	11,14%
Fundos de índices de Renda Variável							Art. 8º, Inciso II, Alínea B							Alocação:	
Fundos Multimercados	8.355.541,91	0,38%	5,00%				Art. 8º, Inciso III							Alocação:	Enquadrado
ITAU INSTITUC MULT JUROS E MOEDAS FC	4.113.642,88	0,19%		87.301.890,71	4,71%	0,40%	OK	OK	OK	0,58%	1,89%	3,69%	8,53%	8,53%	0,58%
VOTORANTIM ATUARIAL MULT CRED PRIV FI	4.241.899,03	0,20%		169.982.520,75	2,50%	1,43%	OK	OK	OK	1,22%	2,11%	5,19%	12,94%	12,94%	1,22%
Fundos de Participação	33.022.534,79	1,52%	5,00%				Art. 8º, Inciso IV, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	1.861.297,05	0,09%		209.367.646,30	0,89%	-	OK	OK	OK	-0,13%	-0,36%	-6,98%	-7,60%	-7,60%	-0,13%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	1.292.777,01	0,06%		195.881.584,90	0,66%	-	OK	OK	OK	4,13%	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL PRINCIPAL INVESTMENTS FICFIP	1.019.358,52	0,05%		-	-	-	OK	OK	OK	-0,12%	-	-	-	-	-
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	13.041.587,75	0,60%		92.595.273,01	14,08%	-	OK	OK	Desenquadrado	-11,17%	-11,12%	-11,60%	102,05%	102,05%	-11,17%
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	1.770.276,99	0,08%		93.697.220,73	1,89%	-	OK	OK	OK	-0,14%	-0,10%	-0,53%	15,87%	15,87%	-0,14%
P2 BRASIL INFRAESTRUTURA III FIQ FIP	7.133.471,31	0,33%		170.076.081,67	4,19%	-	OK	OK	OK	0,00%	7,12%	19,56%	25,86%	25,86%	0,00%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	6.903.766,16	0,32%		570.386.417,68	1,21%	-	OK	OK	OK	-0,09%	2,31%	2,12%	1,62%	1,62%	-0,09%
Fundos Imobiliários			5,00%				Art. 8º, Inciso IV, Alínea B							Alocação:	

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.