

ENQUADRAMENTO LEGAL



JOINVILLE

31/07/2018

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	2.217.187.050,67	100,00%	198,00%								2,18%	-0,88%	0,94%	7,64%	3,75%
META ATUARIAL (INPC + 6%)											0,76%	3,64%	5,58%	9,78%	6,36%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)											0,84%	3,52%	5,63%	10,70%	6,48%
Títulos Públicos	894.876.530,48	40,36%	50,00%				Art. 7º, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - BANCO DO BRASIL	407.984.935,95	18,40%				2,48%					1,73%	0,16%	2,50%	8,05%	4,05%
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - BRADESCO	428.613.253,63	19,33%				2,22%					1,60%	0,03%	2,37%	8,24%	4,11%
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - XP INVESTIMENTOS	58.278.340,90	2,63%				3,86%					2,29%	-1,50%	0,47%	6,92%	3,49%
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham somente títulos públicos	729.193.027,69	32,89%	50,00%				Art. 7º, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	102.928.006,22	4,64%		2.278.192.713,87	4,52%	2,13%	OK	OK	OK	1,46%	0,30%	2,85%	8,05%	4,20%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	297.292.360,31	13,41%		3.931.831.423,60	7,56%	3,73%	OK	OK	OK	2,29%	-1,29%	-0,03%	6,18%	3,35%	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5 FI	91.739.124,79	4,14%		728.155.952,07	12,60%	5,48%	OK	OK	OK	3,11%	-2,70%	-2,49%	4,30%	2,30%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA III FI	10.489.927,74	0,47%		632.369.166,26	1,66%	0,63%	OK	OK	OK	0,73%	1,37%	3,63%	8,17%	4,71%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB IPCA III FI	14.405.040,53	0,65%		1.099.032.145,42	1,31%	2,27%	OK	OK	OK	5,90%	8,14%	10,40%	16,03%	10,40%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	14.266.889,10	0,64%		296.583.201,31	4,81%	3,58%	OK	OK	OK	2,10%	-0,83%	1,71%	7,53%	3,92%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA I FI	14.794.440,57	0,67%		449.127.603,47	3,29%	3,25%	OK	OK	OK	1,98%	-0,64%	2,18%	8,03%	4,05%	
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IX FI	874.635,43	0,04%		362.925.016,97	0,24%	0,17%	OK	OK	OK	0,50%	2,44%	3,70%	7,68%	4,78%	
BTG PACTUAL NTNBF FI RF	26.101.926,00	1,18%		154.724.073,70	16,87%	0,00%	OK	OK	OK	1,34%	0,59%	2,65%	4,75%	2,65%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	27.387.200,00	1,24%		1.373.035.693,85	1,99%	0,00%	OK	OK	OK	1,34%	3,45%	2,72%	7,85%	2,72%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	29.109.840,00	1,31%		388.979.536,86	7,48%	3,85%	OK	OK	OK	2,22%	-1,18%	-1,36%	1,80%	1,65%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	65.779.054,46	2,97%		844.966.903,65	7,78%	5,43%	OK	OK	OK	3,08%	-2,72%	-2,48%	4,33%	2,31%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	34.024.582,54	1,53%		1.264.845.506,38	2,69%	2,12%	OK	OK	OK	1,44%	0,24%	2,74%	7,83%	4,07%	
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	425.499.089,24	19,19%	20,00%				Art. 7º, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	833.789,13	0,04%		1.135.822.818,10	0,07%	0,01%	OK	OK	OK	0,45%	1,30%	2,58%	5,95%	3,08%	
BB PREVIDENCIARIO RF REF DI LP PERFIL FC	82.933,40	0,00%		4.749.425.745,50	0,00%	0,00%	OK	OK	OK	0,52%	1,54%	3,09%	7,11%	3,68%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	10.040.690,85	0,45%		7.916.302.958,59	0,13%	0,01%	OK	OK	OK	0,53%	1,53%	3,03%	6,91%	3,61%	
BRADESCO FI RF REF DI PREMIUM	22.881.432,96	1,03%		9.197.790.011,43	0,25%	0,01%	OK	OK	OK	0,53%	1,54%	3,09%	7,25%	3,68%	
BRADESCO INST FICFI RF IMA B 5	5.087.229,68	0,23%		193.191.801,39	2,63%	5,48%	OK	OK	OK	3,12%	-2,66%	-2,43%	4,32%	2,33%	
BRADESCO INST FICFI RF IMA B	177.043.770,03	7,99%		1.232.430.690,11	14,37%	4,00%	OK	OK	OK	2,34%	-1,48%	-0,16%	6,15%	3,22%	
BRADESCO INST FICFI RF IMA GERAL	94.250.073,69	4,25%		800.764.051,75	11,77%	2,05%	OK	OK	OK	1,54%	-0,01%	2,06%	7,41%	3,91%	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	29.884,33	0,00%		500.288.162,58	0,01%	0,00%	OK	OK	OK	0,47%	1,37%	2,71%	6,21%	3,24%	
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	508.343,65	0,02%		8.037.505.203,48	0,01%	0,01%	OK	OK	OK	0,52%	1,53%	3,03%	6,93%	3,61%	
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II RF FICFI	6.043.854,51	0,27%		1.834.632.251,30	0,33%	0,01%	OK	OK	OK	0,57%	0,81%	2,95%	8,34%	4,48%	
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	65.309.910,75	2,95%		1.394.012.894,53	4,69%	0,01%	OK	OK	OK	0,57%	0,81%	2,93%	8,32%	4,46%	
WA IMA B ATIVO FI RF	18.089.123,40	0,82%		142.658.295,25	12,68%	4,71%	OK	OK	OK	2,84%	-2,57%	-0,59%	5,67%	2,97%	
WA RF ATIVO FI	20.346.985,70	0,92%		1.775.270.811,48	1,15%	0,83%	OK	OK	OK	0,96%	0,76%	2,98%	7,08%	3,81%	
WA SOBERANO II FCFI RF REF SELIC	4.951.067,16	0,22%		194.183.736,61	2,55%	0,01%	OK	OK	OK	0,50%	1,52%	3,03%	6,92%	3,62%	
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	353.272,53	0,02%	1,00%				Art. 7º, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC ITALIA SEN	317.032,10	0,01%		7.055.190,00	4,49%	-	OK	OK	OK	-19,28%	-18,76%	-60,72%	19,90%	-20,78%	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III SENIOR	36.240,43	0,00%		1.033.755,72	3,51%	-	OK	OK	OK	-5,01%	-	-	-	-	
Fundos Crédito Privado	4.478.835,12	0,20%	2,00%				Art. 7º, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	4.291.707,00	0,19%		153.433.382,62	2,80%	1,92%	OK	OK	OK	1,19%	0,54%	2,01%	5,76%	3,02%	
SANTOS CREDIT YIELD FI RF CP	187.128,12	0,01%		13.131.122,80	1,43%	0,83%	OK	OK	OK	1,06%	2,80%	7,98%	15,44%	7,98%	
Fundos Lei nº12.431			-				Art. 7º, Inciso VII, Alínea C						Alocação:		

ENQUADRAMENTO LEGAL



JOINVILLE

31/07/2018

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	2.217.187.050,67	100,00%	198,00%								2,18%	-0,88%	0,94%	7,64%	3,75%
META ATUARIAL (INPC + 6%)											0,76%	3,64%	5,58%	9,78%	6,36%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)											0,84%	3,52%	5,63%	10,70%	6,48%
Fundos de Ações Referenciados	58.513.887,76	2,64%	15,00%				Art. 8º, Inciso I, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB ACOES IBRX INDEXADO FC FI	6.905.972,71	0,31%		152.335.221,43	4,53%	12,90%	OK	OK	OK	8,57%	-8,51%	-7,84%	16,24%	1,83%	
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	7.060.472,86	0,32%		118.052.333,58	5,98%	13,11%	OK	OK	OK	8,89%	-6,74%	-6,74%	19,69%	3,62%	
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44.547.442,19	2,01%		721.542.576,34	6,17%	11,98%	OK	OK	OK	7,10%	-7,30%	-5,98%	16,84%	3,15%	
Fundos de índices de Renda Variável							Art. 8º, Inciso I, Alínea B							Alocação:	
Fundos de Ações	60.621.929,21	2,73%	15,00%				Art. 8º, Inciso II, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BB ACOES DIVIDENDOS FC FI	6.496.239,28	0,29%		438.649.920,08	1,48%	10,47%	OK	OK	OK	6,89%	-9,95%	-8,51%	9,27%	0,67%	
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	4.626.424,62	0,21%		263.003.317,40	1,76%	11,34%	OK	OK	OK	8,22%	-6,66%	-7,29%	13,87%	0,24%	
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	14.813.372,60	0,67%		1.413.203.907,58	1,05%	12,04%	OK	OK	OK	8,54%	-8,47%	-4,99%	18,70%	5,76%	
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.479.926,48	0,29%		396.763.645,16	1,63%	9,31%	OK	OK	OK	4,92%	-11,18%	-10,86%	6,13%	-5,77%	
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.082.910,63	0,32%		99.440.105,83	7,12%	11,24%	OK	OK	OK	5,76%	-10,53%	-6,78%	15,36%	-1,37%	
KINEA PIPE FIA	2.910.695,37	0,13%		69.325.415,28	4,20%	11,56%	OK	OK	OK	6,51%	-61,12%	-74,13%	-70,03%	-73,44%	
SUL AMERICA TOTAL RETURN FIA	10.591.409,63	0,48%		185.007.053,45	5,72%	8,75%	OK	OK	OK	6,00%	-3,78%	0,70%	26,69%	11,92%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	4.934.464,07	0,22%		114.955.807,24	4,29%	11,32%	OK	OK	OK	6,51%	-3,63%	-1,89%	20,40%	6,39%	
WESTERN ASSET VALUATION FIA	2.686.486,53	0,12%		144.387.967,07	1,86%	11,90%	OK	OK	OK	6,47%	-8,39%	-6,34%	13,41%	1,21%	
Fundos de índices de Renda Variável							Art. 8º, Inciso II, Alínea B							Alocação:	
Fundos Multimercados	5.023.340,15	0,23%	5,00%				Art. 8º, Inciso III							Alocação:	Enquadrado
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	5.023.340,15	0,23%		331.602.560,77	1,51%	0,62%	OK	OK	OK	0,33%	1,33%	4,60%	9,10%	5,76%	
Fundos de Participação	38.627.138,49	1,74%	5,00%				Art. 8º, Inciso IV, Alínea A							Alocação:	Enquadrado
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	1.612.791,11	0,07%		181.424.291,63	0,89%	-	OK	OK	OK	-0,15%	-14,48%	-14,44%	-20,41%	-14,55%	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	2.119.532,65	0,10%		321.249.819,90	0,66%	-	OK	OK	OK	43,16%	44,19%	49,41%	57,04%	55,59%	
BTG PACTUAL PRINCIPAL INVESTMENTS FICFIP	3.033.031,06	0,14%		207.672.015,03	1,46%	-	OK	OK	OK	-1,48%	-	-	-	-	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	14.025.497,64	0,63%		99.523.165,97	14,09%	-	OK	OK	OK	-0,06%	-	-	-	-	
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	1.777.215,82	0,08%		94.064.478,94	1,89%	-	OK	OK	OK	0,07%	-0,20%	-0,59%	-1,12%	-0,73%	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	723.343,43	0,03%		5.768.663,82	12,54%	-	OK	OK	OK	-10,24%	-	-	-	-	
P2 BRASIL INFRAESTRUTURA III FIQ FIP	8.463.922,68	0,38%		201.736.820,72	4,20%	-	OK	OK	OK	0,12%	4,73%	11,02%	32,74%	11,03%	
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	6.871.804,10	0,31%		567.745.725,06	1,21%	-	OK	OK	OK	-0,05%	-0,21%	-0,46%	1,65%	-0,55%	
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.