

ENQUADRAMENTO LEGAL



JOINVILLE

31/10/2018

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	2.339.518.192,29	100,00%	198,00%								5,19%	5,00%	4,08%	10,03%	8,94%
META ATUARIAL (INPC + 6%)											0,91%	2,20%	5,93%	10,19%	8,70%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)											0,96%	2,34%	5,95%	10,78%	8,97%
Títulos Públicos	985.982.818,58	42,14%	50,00%				Art. 7º, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - BRADESCO	498.036.710,68	21,29%				2,37%					3,74%	4,01%	4,04%	9,47%	8,29%
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - BANCO DO BRASIL	426.107.110,21	18,21%				2,77%					4,24%	4,44%	4,61%	9,88%	8,68%
CARTEIRA ADMINISTRADA JOINVILLE - XP INVESTIMENTOS	61.838.997,69	2,64%				5,01%					6,65%	6,10%	4,51%	10,50%	9,81%
Fundos Referenciados Renda Fixa que contenham somente títulos públicos	753.067.292,92	32,19%	50,00%				Art. 7º, Inciso I, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B 5 LP FC	97.427.460,21	4,16%		2.809.621.968,16	3,47%	2,18%	OK	OK	OK	3,07%	3,70%	4,01%	9,09%	8,05%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	319.185.560,42	13,64%		3.596.631.650,04	8,87%	4,78%	OK	OK	OK	7,07%	6,40%	5,03%	10,00%	9,97%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5 FI	110.955.215,22	4,74%		712.755.909,82	15,57%	7,19%	OK	OK	OK	10,54%	8,79%	5,85%	10,52%	11,30%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB IPCA II FI	3.609.643,69	0,15%		217.654.284,38	1,66%	1,14%	OK	OK	OK	1,71%	3,13%	4,54%	8,82%	7,98%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB IPCA III FI	12.419.581,52	0,53%		823.370.763,24	1,51%	2,52%	OK	OK	OK	0,99%	6,44%	9,43%	14,90%	10,96%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL IPCA FI	14.971.263,30	0,64%		311.225.885,64	4,81%	3,58%	OK	OK	OK	4,99%	4,94%	4,07%	9,59%	9,05%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL IPCA I FI	15.011.262,09	0,64%		455.710.102,79	3,29%	3,16%	OK	OK	OK	4,11%	4,28%	3,62%	9,52%	8,50%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL IX FI	888.498,97	0,04%		119.614.221,81	0,74%	0,00%	OK	OK	OK	0,52%	1,59%	4,06%	7,04%	6,44%	
BTG PACTUAL NTNB FI RF	26.728.436,00	1,14%		158.437.837,83	16,87%	0,00%	OK	OK	OK	0,57%	2,64%	2,55%	4,57%	3,96%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	29.784.860,00	1,27%		397.999.674,73	7,48%	4,28%	OK	OK	OK	6,15%	2,32%	1,11%	3,72%	4,00%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	72.693.758,18	3,11%		640.791.748,63	11,34%	7,04%	OK	OK	OK	10,50%	8,77%	5,82%	10,54%	11,29%	
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	35.261.754,50	1,51%		1.216.264.327,07	2,90%	2,17%	OK	OK	OK	3,06%	3,64%	3,88%	8,85%	7,86%	
WA IMABS ATIVO FI RENDA FIXA	14.129.998,82	0,60%		293.664.661,71	4,81%	3,83%	OK	OK	OK	4,11%	4,41%	3,57%	9,92%	8,91%	
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	421.619.305,32	18,02%	20,00%				Art. 7º, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC FI	1.400.619,08	0,06%		1.120.973.032,49	0,12%	0,01%	OK	OK	OK	0,45%	1,31%	2,63%	5,41%	4,43%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFL FC	84.247,25	0,00%		5.498.059.726,89	0,00%	0,00%	OK	OK	OK	0,53%	1,58%	3,15%	6,53%	5,32%	
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	23.461.812,89	1,00%		7.545.933.053,51	0,31%	0,01%	OK	OK	OK	0,53%	1,55%	3,10%	6,35%	5,21%	
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	23.230.285,87	0,99%		7.898.846.795,17	0,29%	0,01%	OK	OK	OK	0,54%	1,56%	3,13%	6,46%	5,31%	
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	5.531.303,39	0,24%		166.775.701,08	3,32%	7,04%	OK	OK	OK	10,50%	8,73%	5,84%	10,52%	11,26%	
BRADESCO INST FICFI RF IMA B	134.601.861,72	5,75%		1.195.772.333,52	11,26%	5,06%	OK	OK	OK	7,43%	6,50%	4,93%	9,96%	9,93%	
BRADESCO INST FICFI RF IMA GERAL	97.924.488,22	4,19%		735.536.085,15	13,31%	2,41%	OK	OK	OK	3,62%	3,90%	3,89%	8,87%	7,96%	
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	39.443,35	0,00%		641.747.198,77	0,00%	0,00%	OK	OK	OK	0,47%	1,37%	2,76%	5,67%	4,65%	
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	350.043,33	0,01%		8.101.441.130,94	0,01%	0,01%	OK	OK	OK	0,53%	1,54%	3,10%	6,35%	5,21%	
ITAU INST ALOCAÇÃO DINAMICA II RF FICFI	7.686.960,95	0,33%		2.358.100.059,21	0,33%	0,43%	OK	OK	OK	0,51%	1,30%	2,13%	6,82%	5,84%	
ITAU INST ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	66.162.401,46	2,83%		1.492.081.353,77	4,43%	0,43%	OK	OK	OK	0,51%	1,31%	2,13%	6,81%	5,82%	
WA IMA B ATIVO FI RENDA FIXA	18.959.899,86	0,81%		138.651.444,36	13,67%	6,60%	OK	OK	OK	8,26%	7,27%	4,61%	10,58%	10,56%	
WA RENDA FIXA ATIVO FI	32.826.569,33	1,40%		1.667.035.789,20	1,97%	1,40%	OK	OK	OK	1,42%	2,27%	3,04%	7,34%	6,17%	
WA SOBERANO II FCFI RENDA FIXA REF SELIC	9.350.368,62	0,40%		134.447.067,84	6,95%	0,00%	OK	OK	OK	0,50%	1,52%	3,07%	6,34%	5,20%	
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	111.408,94	0,00%	1,00%				Art. 7º, Inciso VII, Alínea A						Alocação:	Enquadrado	
FIDC ITALIA SEN	82.388,13	0,00%		1.833.454,40	4,49%	-	OK	OK	OK	-55,58%	-74,01%	-78,89%	-69,80%	-79,41%	
FIDC MULTISECTORIAL BVA MASTER III SENIOR	29.020,81	0,00%		827.816,27	3,51%	-	OK	OK	OK	-6,38%	-19,92%	-24,62%	-52,05%	-96,70%	
Fundos Crédito Privado	4.690.746,28	0,20%	2,00%				Art. 7º, Inciso VII, Alínea B						Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	4.430.841,00	0,19%		154.584.685,18	2,87%	1,43%	OK	OK	OK	2,06%	3,24%	3,80%	7,16%	6,35%	
SANTOS CREDIT YIELD FI RF CP	259.905,28	0,01%		18.343.703,20	1,42%	0,16%	OK	OK	OK	0,33%	17,48%	19,98%	26,27%	25,53%	
Fundos Lei nº12.431							Art. 7º, Inciso VII, Alínea C						Alocação:		

ENQUADRAMENTO LEGAL



JOINVILLE

31/10/2018

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	2.339.518.192,29	100,00%	198,00%											
META ATUARIAL (INPC + 6%)										5,19%	5,00%	4,08%	10,03%	8,94%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)										0,91%	2,20%	5,93%	10,19%	8,70%
										0,96%	2,34%	5,95%	10,78%	8,97%
Fundos de Ações Referenciados	63.993.840,91	2,74%	15,00%				Art. 8º, Inciso I, Alínea A						Alocação:	Enquadro
BB ACOES IBRX INDEXADO FC FI	7.576.603,40	0,32%		167.167.484,70	4,53%	13,91%	OK	OK	OK	10,03%	9,71%	0,37%	14,35%	11,72%
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	7.794.235,60	0,33%		197.224.605,27	3,95%	14,12%	OK	OK	OK	10,17%	10,39%	1,53%	17,44%	14,39%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	48.623.001,91	2,08%		782.573.100,16	6,21%	14,09%	OK	OK	OK	11,97%	9,15%	1,18%	14,89%	12,59%
Fundos de índices de Renda Variável							Art. 8º, Inciso I, Alínea B						Alocação:	
Fundos de Ações	61.537.667,07	2,63%	15,00%				Art. 8º, Inciso II, Alínea A						Alocação:	Enquadro
BB ACOES DIVIDENDOS FC FI	7.135.007,17	0,30%		471.795.315,59	1,51%	11,70%	OK	OK	OK	9,44%	9,83%	-1,09%	10,89%	10,57%
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	5.153.420,15	0,22%		305.635.240,25	1,69%	14,09%	OK	OK	OK	11,52%	11,39%	3,97%	14,22%	11,66%
BRADESCO FIA DIVIDENDOS	16.459.518,17	0,70%		1.596.653.734,14	1,03%	14,73%	OK	OK	OK	10,45%	11,11%	1,70%	20,55%	17,51%
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	1.878.098,41	0,08%		151.714.901,57	1,24%	14,94%	OK	OK	OK	9,98%	10,19%	2,96%	21,10%	18,02%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.993.348,47	0,30%		420.020.936,25	1,66%	14,01%	OK	OK	OK	12,57%	7,92%	-4,15%	3,69%	1,70%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.456.120,23	0,32%		105.254.972,12	7,08%	13,74%	OK	OK	OK	10,34%	5,27%	-5,81%	7,47%	3,83%
KINEA PIPE FIA	1.342.464,86	0,06%		31.974.123,82	4,20%	9,36%	OK	OK	OK	9,21%	-53,88%	-82,07%	-87,63%	-87,75%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	5.383.778,45	0,23%		160.769.636,54	3,35%	13,66%	OK	OK	OK	11,02%	9,11%	5,15%	18,33%	16,07%
WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.735.911,16	0,42%		133.043.571,63	7,32%	16,59%	OK	OK	OK	9,75%	4,43%	-4,33%	3,72%	5,70%
Fundos de índices de Renda Variável							Art. 8º, Inciso II, Alínea B						Alocação:	
Fundos Multimercados	9.393.245,80	0,40%	5,00%				Art. 8º, Inciso III						Alocação:	Enquadro
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULT	9.393.245,80	0,40%		356.678.946,82	2,63%	1,59%	OK	OK	OK	1,41%	1,54%	2,89%	7,95%	7,39%
Fundos de Participação	39.121.866,47	1,67%	5,00%				Art. 8º, Inciso IV, Alínea A						Alocação:	Enquadro
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	1.605.361,10	0,07%		180.588.481,95	0,89%	-	OK	OK	OK	-0,18%	-0,46%	-14,87%	-15,14%	-14,95%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	2.329.921,25	0,10%		353.029.723,40	0,66%	-	OK	OK	OK	-0,22%	5,06%	51,48%	68,37%	63,46%
BTG PACTUAL PRINCIPAL INVESTMENTS FICFIP	2.823.590,76	0,12%		191.991.963,70	1,47%	-	OK	OK	OK	-3,59%	-6,91%	177,13%	176,65%	177,13%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	13.996.444,69	0,60%		99.317.009,88	14,09%	-	OK	OK	OK	-0,07%	-0,21%	-0,67%	-5,00%	-5,06%
FIP CAIXA INCORPORACAO IMOBILIARIA	1.769.919,65	0,08%		93.678.307,59	1,89%	-	OK	OK	OK	-0,14%	-0,41%	-0,61%	-1,10%	-1,14%
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	459.164,91	0,02%		3.661.840,13	12,54%	-	OK	OK	OK	-19,42%	-36,52%	-	-	-
PZ BRASIL INFRAESTRUTURA III FIQ FIP	9.254.842,28	0,40%		220.684.346,45	4,19%	-	OK	OK	OK	-2,00%	9,34%	14,52%	30,04%	21,40%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	6.882.621,83	0,29%		568.639.481,51	1,21%	-	OK	OK	OK	0,08%	0,16%	-0,06%	2,00%	-0,40%
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.